

## Abstrakt

V této diplomové práci provádíme komparativní analýzu toho, jak moderní metody strojového učení dokáží predikovat výnosy aktiv při použití malého množství data. Mezi použitými metodami jsou například elastic nets, náhodné lesy, nebo neuronové sítě. Konstatujeme, že tyto metody nedokáží predikovat lépe než jednoduchý lineární model obsahující pouze 5 faktorů. Moderní machine learning metody by se tedy měly aplikovat velmi opatrně, neboť nemusí být tak silné, jak by se mohlo zdát, pokud je aplikujeme za nepříznivých podmínek.

<b>Klasifikace JEL</b>	C45, C52, C53, C58, G12
<b>Klíčová slova</b>	oceňování aktiv, strojové učení, predikce výnosů, regrese, rozhodovací strom, náhodný les, neuronová síť
<b>Název práce</b>	Využívání Strojového Učení pro Predikci Výnosů Aktiv při Použití Omezených Datasetů
<b>E-mail autora</b>	petrasek.lks@gmail.com
<b>E-mail vedoucího práce</b>	barunik@fsv.cuni.cz