

Posudek oponenta diplomové práce Jaromíra Šatánka “Stroj pro algoritmické obchodování”

Hlavním úkolem diplomanta bylo navrhnout a vyvinout systém umožňující algoritmické obchodování na burzách cenných papírů. V zadání je kladen důraz na latenci, stabilitu, modulárnost a modifikovatelnost řešení – možnosti přidávání nových algoritmů, či napojení na nové zdroje dat.

Diplomová práce Jaromíra Šatánka všechny tyto body splňuje. Systém mi byl předveden jako funkční (v simulované verzi). Podle vyjádření autora se zdá, že se připravuje jeho nasazení v ostrém prostředí. Práce postupně popisuje jednotlivé problémy a diskutuje jejich řešení. Jsou dokumentovány všechny použité součásti. Ocenit lze rovněž obrovské množství nástrojů a prostředků, které autor ve své práci použil.

K práci mám následující dotazy, připomínky a poznámky:

- Proč si autor nedal práci s překladem některých základních pojmů – např. „order“? V závěru práce je uvedeno ve slovníčku pojmů vysvětlení „order“ = „příkaz na prodej či koupi cenného papíru“. Pokud by tedy byl český termín „objednávka“ zavádějící, nestačil by termín „příkaz“? V celé práci se skloňuje „order“ jako by to bylo typicky české slovo (seznam „orderů“, každému „orderu“, ...), což text práce myslím trochu znehodnocuje. Podobně je to s řadou dalších termínů, ale ta nebo ten „order“ je asi nejvíce patrný.
- Proč nejsou pro dokumentaci komunikace a protokolů využity diagramy UML, jejichž sémantika je zřejmá. Takové diagramy by usnadnily čtenáři pochopení předloženého textu např. v kapitole 3.
- Proč není v práci nikde uveden datový model? Celá kapitola 4 mluví o perzistentním úložišti, ale struktura ukládané informace není nikde popsána (ani v jedné z variant).
- V odstavci 7.5 se konstatuje, že „*existují testovací pluginy*“, vyvinuté speciálně pro dokonalé otestování systému. V přílohách práce jsou uvedeny zdrojové kódy testů. Nikde ale není uveden alespoň stručný popis těchto testovacích „pluginů“ (použiji-li termíny zavedené v práci)?

Přes výše uvedené výhrady považuji práci za velmi přínosnou a prakticky nesporně užitečnou. Vzhledem k objemu odvedené práce ji navrhuji rozhodně přijmout k obhajobě.

V Praze 15. května 2009

Doc. Ing. Karel Richta, Csc.
katedra softwarového inženýrství MFF UK Praha
Malostranské nám.25, 118 00 Praha 1
oponent