

Posudek bakalářské práce

předložené na Matematicko-fyzikální fakultě
Univerzity Karlovy v Praze

posudek vedoucího posudek oponenta

Autor/ka: Tomáš Helešic

Název práce: Investment Strategies Simulator

Studijní program a obor: Informatika, Obecná informatika

Rok odevzdání:2010

Jméno a tituly vedoucího/opponenta: Tomáš Poch

Pracoviště: KDSS MFF UK

	e x c e l e n t n í	o d p o v í d a j í c í	s l a b š í	n e v y h o v u j í c í
Náročnost zadaného tématu		X		
Míra splnění zadání			X	
Rozsah práce			X	
Struktura textové části práce			X	
Analýza				X
Vývojová dokumentace		X	X	
Uživatelská dokumentace		X	X	
Jazyková a typografická úroveň			X	
Návrh a design implementace			X	
Kvalita zpracování softwarové části			X	
Stabilita aplikace			X	

Nejvýznamnější klady:

Jednotlivé technické indikátory a providery dat z internetu jsou dodány jako dynamické knihovny, což umožňuje přidávat nové bez zásahů do hlavního programu.

Nejzávažnější nedostatky:

V textu práce chybí definice investiční strategie a jejího vyhodnocení. V samotné práci se potom za investiční strategii považuje v principu libovolný algoritmus mající přístup k úplné historii obchodů konkrétního titulu v jistém časovém úseku interpretované pomocí indikátorů technické analýzy. To lze jen těžko považovat za realistický model – algoritmus může podvádět a činit rozhodnutí na základě budoucího vývoje. Takto specifikovanou strategii také ze zřejmých důvodů nelze po vyzkoušení na simulátoru použít v reálném čase. Čekal bych spíše reaktivní model řízený událostmi generovanými zvolenými indikátory.

Za vyhodnocení strategie se pak považuje jediné číslo – zisk (ztráta) dosažený při použití strategie na konkrétní titul v konkrétním časovém úseku. Výsledek simulace tedy nelze přímo použít k obecnému porovnání strategií. Jde tedy spíše o minimalistické splnění jednoho z cílů práce.

Text práce neobsahuje analýzu. Práce tedy přinejmenším postrádá bližší zdůvodnění následujících bodů:

- Uživatelsky přívětivá specifikace investičních strategií je zmíněna už v zadání jako jeden z požadavků. V textu práce se člověk více méně mimochodem dozví, že je za tímto účelem použit CScript. Tato volba není nijak komentována, stejně tak jako fakt, že algoritmus má přístup k úplné historii.
- Není diskutován design hlavního programu. Například program potřebná data načítá z internetu, ukládá do databáze a až nad databází provádí simulaci strategie. Není vysvětleno, proč je databáze potřeba, ani volba konkrétního databázového schématu.
- Chybí diskuse scénáře použití aplikace. Například jsou zde dva módy běhu aplikace, přičemž strategie lze vyhodnocovat jen v jednom. Není jasné proč.
- Není zdůvodněna volba množiny dodaných indikátorů.

Text práce se nečte dobře, což je způsobeno jak jeho strukturou, tak úrovní angličtiny. Vysvětlení technické analýzy, které by patřilo spíše do úvodu, jen poměrně úzce vysvětluje dva konkrétní cenové vzory, bez vazby na následující technické indikátory. Ve vysvětlení krátké a dlouhé pozice se najednou mluví místo o akciích o opcích aniž by to bylo třeba (navíc pojem opce není vysvětlen). Celkově vzato jsou vysvětlovány věci, které v rámci práce nejsou potřeba. Na druhou stranu chybí nejdůležitější definice a čtenář ani tak nezíská ucelený přehled o problematice.

V neposlední řadě se v úvodu objevuje tvrzení: „The stock exchange in general is not creating goods, but every profit is payed by loss of somebody else.“, které je v přímém rozporu se smyslem existence akciových trhů. S tím souvisí i fakt, že autor nezmiňuje alternativu k technické analýze – fundamentální analýzu, ani předpoklady, za kterých technická analýza funguje.

Program nainstalovaný pomocí dodaného instalátoru nelze spustit (špatná práva u souboru s databází), odevzdaná solution do Visual Studia nejde přeložit kvůli tomu, že vyžaduje import zaheslovaných certifikátů.

	v	v	d	n
	ý	e	o	e
	b	l	b	p
	o	m	ř	r
	r	i	e	o
	n	d		s
	ě	o		p
		b		ě
		ř		l
		e		/
				a
Návrh známky				X

Datum: 23. 7.

Podpis: