

Posudek vedoucího ^{bakalářské} ~~diplomové~~ práce A. Tarabič

Kellyho kritérium

Práce je věnována vlastnostem Kellyho kritéria, které odpovídá maximalizaci exponenciálního růstu portfolia v nekonečném časovém horizontu za předpokladu, že investor může celý svůj kapitál po každé znovu reinvestovat bez dodatečných nákladů. V práci se také využívají výsledky z ergodické teorie a je zde i naznačena souvislost log-optimálního výnosu s pojmy pocházející z teorie informace.

Studentka v průběhu práce prokázala schopnost samostatně pracovat s odbornou literaturou, kterou si často sama dohledávala. Až na drobná opomenutí je práce napsána bez zbytečných chyb a je jí možno uznat jako bakalářskou práci na MFF UK.

16.6.09

