

Posudek

vedoucího oponenta
 diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Pavel Šůva

Název práce: Drawdown v úlohách optimalizace portfólia

Jméno oponenta: Doc. RNDr. Petr Lachout, CSc

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu

nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji uznat jako bakalářskou.

Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření oponenta:

Práce se zabývá měřením rizika při finančních operacích. Speciálně se zaměřuje na drawdown míry rizika. V práci jsou definovány a diskutovány DaR, CDaR, VaR, CVaR a další odvozené míry. Pro míry rizika CDaR a CVaR je studována úloha nalezení optimálního portfólia a to, jak na trhu s bezrizikovým aktivem, tak bez něho. Teorie je aplikována na data z pražské burzy 1.9.2005 – 28.2.2007.

Místo, datum, podpis oponenta: Praha, 11.6.2009

