

Posudek

vedoucího oponenta
 diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Soňa Kysel'ová

Název práce: Analýza investic

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 předkládá přehled teorie potřebné k analýze investic. Nejdříve uvádí přehled cenných papírů, které jsou základními finančními instrumenty. Uvádí jejich charakteristiky a postupy jejich výpočtu. Pak jsou charakteristiky studovány pro portfólia složená z cenných papírů. Pro hledání optimálního portfólia je diskutován Markowitzův model. Na závěr je uvedena situace, kdy je možno do portfólia zařadit bezrizikový cenný papír. V této části je uveden ilustrativní příklad, který je však špatně. Již sestavení potřebné matice je chybné.

Místo, datum, podpis oponenta: Praha, 11.6.2009



Připomínky a poznámky oponenta k práci Soni Kyselové „Analýza investic“

1. Na straně 12 ve vzorci (2.5) má být v sumě mocnina "k" místo "n".
2. Na řádce 21₈ chybí střední hodnota u prostředního členu.
3. Na řádce 26₂ má být $\alpha \in [0, 1]$.
4. Symbol "A" je použit ve větě na straně 27 v jiném významu nežli v důkaze této věty.
5. Příklad na stranách 31-32 používá jiné označení nežli bylo zavedeno při předchozím výkladu teorie. Značně to ztěžuje orientaci čtenáře v příkladu.
6. Výpočty na straně 32 jsou špatně. Již sestavení rozšířené matice je chybné.
7. Na stranách 32-33 mají být odkazy na formule v kulatých závorkách.
8. Třetí argument na straně 33 je podivný. Zřejmě chybí, že se týká formule (3.14).

11.června 2009

Doc.

