

Posudek vedoucího bakalářské práce

Autor/Autorka: **Jan Němec**

Název práce: **Markowitzův model s omezeními**

Jméno vedoucího: **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 citované z literatury

netriviální kompilace teorie je aplikována na příklad

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

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

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet

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 příkládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření vedoucího:

Práce je zaměřena na Markowitzův model s omezeními. Jsou v ní probírána a diskutována omezení daná legislativou pro chování různých bankovních subjektů investujících na burzovním trhu.

Autor pracoval na textu pilně, svědomitě a se zájmem. Vznikl pěkný přehled v praxi využívaných omezení doplněný teorií pro hledání optimálního portfolia.

V práci jsem našel překlepy:

1. Ve Větě 11, str. 10, má být uvažováno optimální řešení druhé úlohy, nikoli první.
2. Podkapitola 4.7 - „Toto omezení se využívá indexů“, „..... vývoj vývoj“
3. V popisu Tier I, str. 32 - „Konkrétně se se“

Místo, datum, podpis vedoucího:

Praha, 4.9.2011, Doc. RNDr. Petr Lachout, CSc.