Posudek oponentky na bakalářskou práci

Jana Voříška

VYBRANÉ METODY OPTIMALIZACE VE FINANCÍCH

Obsahem práce je prezentace možností programu Mathematica 5.2 při hledání optimálního portfolia podle Markowitzovy teorie. Ta je stručně nastíněna, hlavní část textu je však věnována podrobnému popisu funkcí a metod používaných příslušným softwarem. Praktická aplikace byla provedena na souboru akcií významných firem působících v České republice.

Posluchač prokázal schopnost zvládnout netriviální práci s programem Mathematica. Text je psán přehledně, bez závažných chyb. Postrádám pouze závěr, v němž by například mohl být podán shrnující komentář k různým optimálním portfoliím získaným různými přístupy. Portfolia na str. 21-22 by si také zasloužila podrobněji okomentovat, není zcela jasné, jak se lišila jejich konstrukce.

Předložená práce představuje přínos pro finanční praxi tím, že naznačuje možnosti softwaru, který by si zasloužil širší použití než dosud má. Doporučuji její přijetí k obhajobě.

V Praze 7.6.2006

RNDr. Jitka Zichová, Dr.