

Posudek oponenta diplomové práce

Autor/Autorka

Bc. Miroslav Řehoř

Název práce

Tvorba a optimalizace automatického obchodního systému

Studijní obor

Finanční informatika a statistika

Oponent práce

JUDr. Ing. David Martinčík, Ph.D.

Splnění cílů práce:

nadstandardně velmi dobře splněny s výhradami nebyly splněny

Odborný přínos práce:

nové výsledky netradiční postupy zpracování výsledků z různých zdrojů shrnutí výsledků z různých zdrojů bez přínosu

Matematická (odborná) úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu přiměřený počet méně podstatné, větší množství podstatnější, větší množství závažné

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Slovní hodnocení a dotazy:

Předložená diplomová práce představuje studentův vlastní algoritmus automatického obchodování. Student navrhl vlastní algoritmus a otestoval jeho úspěšnost na reálných datech, zároveň ho porovnal se strategií náhodného obchodování. Navržený algoritmus se zdá poměrně sofistikovaný, cíle práce byly tedy vesměs splněny, nicméně mám velké výhrady jakým způsobem.

Práce má nevyváženou strukturu, některé kapitoly jsou jednostránkové a tedy nijak dále nečleněné a naopak jiné jsou dlouhé a členěné do mnoha podkapitol. Jazykové zpracování je na slušné úrovni, nicméně některé termíny jsou nestandardní: „diskrétní obchodování“ nebo „exekuce obchodních příkazů“ na straně 10. Autor často míchá pojem „strategie“ a „signál“. Text se jeví jako nevyvážený, například zbytečné je vykreslování funkcí hustot a distribučních funkcí v kapitole 8. U převzatých obrázků nejsou uvedeny zdroje.

Především postrádám testování jak AOS, tak náhodného obchodování na jiných časových řadách. Použitá časová řada zjevně bude obsahovat nějaký trend, když náhodné obchodování bylo v průměru úspěšné (bez zahrnutí poplatků). Dále jako naprosto nedostatečnou považuji použitou literaturu, kde převládají internetové zdroje.

Otázky k obhajobě:

- 1) Proč AOS a náhodné obchodování jsou každé naprogramované v jiném sw?
- 2) Je průměrný zisk/ztráta z obchodů přepočtený p.a. nebo nikoliv? (vzorec 6.2.)
- 3) Co přesně znamená pravděpodobnost zisku/ztráty v tom samém vzorci?

Práci doporučuji – ~~nedoporučuji~~ uznat jako kvalifikační (*nehodící se škrtněte*).

Navrhuji hodnocení známkou:

Dobře

Datum, jméno a podpis: 15. 6. 2017

A handwritten signature in blue ink, appearing to read 'Markus', is written in a cursive style.