

Hodnocení vedoucího diplomové práce

Autor/Autorka

Šárka Kopová

Název práce

Stabilizace odhadu kovarianční matice pro Markowitzův model portfolia

Studijní obor

Matematika a finanční studia

Vedoucí práce

RNDr. Blanka Šedivá, 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

Přístup autora k řešení práce, spolupráce s vedoucími práce:

samostatná práce s výbornou komunikací pečlivá práce, drobné zásahy vedoucího pečlivá práce, podstatnější zásahy horší komunikace špatný přístup k práci

Slovní hodnocení a dotazy:

Předložená diplomová práce se věnuje odhadu kovarianční matice vstupující do procesu konstrukce portfolia v Markowitzově smyslu. Kovarianční matice je jedním z velmi důležitých faktorů, která ovlivňuje výsledné optimalizované portfolium. Za nejzajímavější výsledky práce považuji analýzy zaměřené na to, jak dlouhá má být historie, ze které je odhadována kovarianční matice. Pro konkrétní analýzy byla oproti původnímu záměru použita data akcií obchodovaných na NYSE (nikoliv na BCPP Praha) a práce tak získala obecnější platnost.

Celkově hodnotím práci jako zdařilou a doporučuji k obhajobě. Konkrétní hodnocení navrhuji v rozsahu výborně – velmi dobře.

Navrhují hodnocení známkou:

VÝBORNĚ

Datum, jméno a podpis:

5.6.2019