

Posudek oponenta diplomové práce

Student: Bc. Petr Šild
Název diplomové práce: **Využití externích dat pro investiční modelování**
Vedoucí práce: RNDr. Ján Gogola, PhD.
Oponent práce: prof. RNDr. Viera Pacáková, PhD.
Pracovní pozice oponenta: profesor, UMKM, FES, Univerzita Pardubice

Kritéria hodnocení práce

| | výborně | velmi dobře | vyhovující | nevyhovující | nelze hodnotit |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Stupeň splnění cíle práce | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Adekvátnost použitých metod | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu) | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Logická stavba práce a rozsah | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Práce s českou a zahraniční literaturou včetně citací | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Formální úprava práce (text, grafy, tabulky) | <input type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie) | <input type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

Využitelnost výsledků práce

| | vysoká | střední | nízká | nelze hodnotit |
|------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Pro teorii | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Pro praxi | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

Ostatní připomínky k práci

Cíl diplomové práce byl stanoven značně aplikačně, navrhnout investiční model pro určení podílu aktiv držených v portfoliu investora na základě posouzení rizikových situací pomocí tržních a externích dat. Už tato skutečnost a hlavně důsledné splnění stanoveného cíle zařazuje diplomovou práci mezi práce mimořádné.

V práci diplomant prezentuje využití široké skály získaných vědomostí, dovedností a zručností napříč všemi předměty studijní specializace Management finančních rizik studijního oboru Pojistné inženýrství, jako i vysoký stupeň znalostí získaných samostudiem a v neposlední míře svůj zájem o řešenou problematiku.

Složitost a komplexnost vytvořeného modelu na základě rozsáhlého souboru dat, využití SQL databáze, využití pokročilých metod statistiky, samostatného zvládnutí programovacího jazyka Python a metod vizualizace pomocí nástroje Qlik Sense Business Intelligence, co je široký záběr i pro kolektivní dílo datových analytiků a programátorů, je důvodem ocenit předkládanou diplomovou práci jako práci mimořádných kvalit a nadstandardní úrovně.

Praktická část, obsahující popis a výsledky postupných kroků tvorby investičního modelu, tvoří přibližně čtvrtinu předkládané práce, co se na první pohled může jevit jako paradoxní. Teoretická část, shrnutá do třech předchozích kapitol, je však nutným a logickým úvodem praktické části. Svědčí rovněž o dokonalé znalosti diplomanta potřeb fundamentální analýzy pro investování na kapitálových trzích i moderních přístupů k této analýze, využívajících moderní nástroje informačních technologií.

Identifikace záznamu:

Agenda závěrečných prací

.....

Otázky a náměty k obhajobě

1. Zkuste odhadnout, kolik času stě věnovali tvorbě investičního modelu, prezentovaného v diplomové práci.
2. V diplomové práci je použito množství anglických výrazů. Vyjádřete svůj názor na potřebu a možnost jejich překladu do češtiny.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.
Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **A**

V Pardubicích 24.5.2019

Podpis