

Posudek vedoucího bakalářské práce

Student: Lukáš Souček
Číslo studenta: E21569
Název bakalářské práce: Optimalizace investičního portfolia pomocí metody Value at Risk
Cíl práce: Cílem práce je navrhnout optimální investiční portfolio. Hlavním kritériem bude ocenění příslušného tržního rizika pomocí hodnoty Value at Risk.
Vedoucí práce: Mgr. Hana Boháčová, Ph.D.
Studijní program: B0412A050011 Finance
Akademický rok: 2023/2024

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

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"/>
Původnost zpracování tématu	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Adekvátnost použitých metod	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" 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 type="checkbox"/>	<input checked="" 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 type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Využitelnost výsledků práce

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

Ostatní připomínky k práci

Předkládaná bakalářská práce se věnuje návržení optimálního investičního portfolia pomocí metody Value at Risk. V úvodní části je vysvětlena podstata metody a jsou zde představeny tři často používané varianty metody VaR. Dále je metoda aplikována na akciové portfolio, dluhopisové portfolio a komoditní portfolio za účelem porovnání rizikovosti. V poslední části práce je na základě předchozích výsledků navržena optimální kombinace aktiv, která by měla patřit do investičního portfolia. Cíl práce byl, dle mého názoru, splněn beze zbytku. Práce je logicky členěna a srozumitelně napsána. Po formální stránce je práce, až na drobnosti, v pořádku. V textu jsou gramatické chyby a stylistické nedostatky, které, bohužel, poněkud kazí jinak příznivý dojem.

Vzhledem k výše uvedenému bakalářskou práci doporučuji k obhajobě a hodnotím ji známkou C.

Vyjádření k výstupům ze systému Theses

Nejvyšší zjištěná míra podobnosti byla 2 %. Práce je původní, nejedná se o plagiát.

Otázky a náměty k obhajobě

Popište prosím kritéria, na jejichž základě jste vybíral složky tvořící akciové, dluhopisové a komoditní portfolio použité v páté kapitole práce.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto bakalářskou práci navrhuji hodnotit známkou: **C**

V Pardubicích 13.8.2024

Podpis