

Posudek vedoucího k bakalářské práci *Dany Staníkové*:

Asymptotické řízení portfolia

Práce je věnována teorii asymptotického řízení v diskrétních markovských řetězcích a její použití na jednodimenzionální problém řízení portfolia při existenci proporcionálních transakčních nákladů. V práci se podařilo numericky ověřit korespondenci mezi řešením spojitého problému a příslušné diskrétní aproximace.

V práci je možné vyzvednout srozumitelné a důsledné rozepsání potřebné diskrétní teorie odstraňující nepřehledné značení a občasně nesrovnalosti v citované literatuře. Součástí práce je také poměrně stručný a citlivý popis spojitého případu, který čtenáři umožňuje okamžitě pochopit klíčovou volbu funkce oceňující přechody v řetězci, aniž by nutně musel ovládat stochastickou analýzu.

Práce splňuje všechny požadavky, které byly uvedeny v zadání, a lze ji uznat jako bakalářskou práci na MFF UK.

19.6.06

Petr Dostál.