

Hodnocení vedoucího diplomové práce

Student: Šeda Jan, Bc.

Téma: Algoritmické obchodování na burze s využitím umělých neuronových sítí (id 18570)

Vedoucí: Szóke Igor, Ing., Ph.D., UPGM FIT VUT

1. Informace k zadání

Tato práce vychází z diplomové práce z roku 2010 a 2012 na stejné téma. Cílem bylo inspirovat se minulými pracemi, (re)implementovat obchodní algoritmy, ověřit jejich funkčnost na jiných datech a snažit se je zlepšit. V této práci se student zabýval jak ověřením stávajících, tak trénováním nových strategií. Své algoritmy se rozhodl testovat na Bitcoinových burzách.

Náročnost práce spočívá zejména v nutnosti pochopit princip umělých neuronových sítí, vlastností burzovních dat a tvorbou komplexního systému, který bude profitabilní.

Zadání bylo splněno.

2. Práce s literaturou

Student pracoval s literaturou samostatně a aktivně. Nastudoval doporučenou literaturu týkající se obchodování na burze a sám si vyhledal další práce zabývající se podobnou problematikou.

3. Aktivita během řešení, konzultace, komunikace

Student se na konzultacích v zimním semestru ukázal pouze jednou. V letním semestru byla jeho aktivita lepší, nicméně nepravidelná. Na konzultacích byl připraven a ukázal pokrok při řešení. Měl představu, jaké budou jeho další kroky.

K vlastnímu jádru práce (trénování neuronových sítí) se dostal až v březnu. Vedoucí musel průběžně na studenta vyvíjet tlak, aby předešel případnému "nestihnutí" dokončení a odevzdání práce v ucelené formě.

4. Aktivita při dokončování

Student dokončil práci v silné časové tísni. Struktura a text práce byl konzultován asi z poloviny. Poznámky vedoucího byly zapracovány. Vedoucí nemá úplnou představu v jakém stavu skončily experimenty, a zdali jsou z nich vyvozeny rozumné závěry.

5. Publikační činnost, ocenění

Není.

6. Souhrnné hodnocení

uspokojivě (D)

Kladně hodnotím samostatnost. Student měl celkem jasnou představu toho, co bude dělat. Bohužel rozvržení pracovního tempa bylo chaotické a vedlo ke zpoždění. S blížícím se termínem odevzdání stoupala aktivita. Student využil každé minuty, aby dostal text a experimentální část co možná do nejlepšího stavu.

Prohlášení: Uděluji VUT v Brně souhlas ke zveřejnění tohoto hodnocení v listinné i elektronické formě.

V Brně dne: 1. června 2016

.....
podpis