

POSUDEK VEDOUcíHO BAKALÁŘSKÉ PRÁCE

Jméno studenta: Dmitrii Khustudninov

Vedoucí bakalářské práce (BP): Ing. Martin Jančík

Téma BP: Developing Your Own Strategy for Trading Digital Assets

Ak. rok: 2023/2024

Poznámky k vyplňování posudku:

- U hodnocení jednotlivých kritérií použijte následující stupnici: A – splněno výborně bez výhrad, B – splněno velmi dobře s drobnými připomínkami, C – splněno průměrně, D – splněno s nedostatky, E – splněno, ale s výraznými nedostatky, F – nesplněno.
- Pokud je jakékoliv kritérium ohodnoceno stupněm F, práce musí být celkově hodnocena jako nevyhovující, která nesplňuje kritéria pro obhajobu BP a nelze takovou práci doporučit k obhajobě.
- Vedoucí BP se musí slovně vyjádřit ke každému hodnotícímu kritériu!

Hodnotící kritéria:

Hodnocení

Hodnotící kritéria:	Hodnocení
1. Cíle a metody práce	A
<i>Cíle práce jsou splněny bez výhrad. Stejně tak metody zvolené v úvodu jsou v práci použity a dodrženy.</i>	
2. Teoretická část práce	A
<i>Teoretická část obsahuje velmi podrobný a rozsáhlý podklad pro praktickou část. Jednotlivé poznatky z teoretické části jsou následně využity pro sestavení komplexní tradingové strategie aplikované v praxi s reálným kapitálem.</i>	
3. Praktická část práce – analýza	A
<i>V analytické části práce se student zaměřuje na sestavení tradingové strategie na základě poznatků z teoretické části a, což je patrné, na základě praktických znalostí a zkušeností s danou problematikou. Strategie je dále testována na historických datech a následně optimalizována tak, aby za daných podmínek dosahovala co nejlepších výsledků. Toto je standardní přístup k vývoji tradingové strategie a student prokazuje hlubokou znalost dané problematiky.</i>	

4. Praktická část práce – řešící / návrhová / výzkumná	A
<i>Po sestavení, otestování a vyladění tradingové strategie se student pouští do její aplikace v praxi s reálným kapitálem. Během 18-ti obchodů vykazuje, že daná strategie funguje v praxi a dosáhl s ní pozitivního zhodnocení vloženého kapitálu. Bylo by zajímavé vidět výsledky strategie i v delším časovém horizontu a s větším počtem obchodů, ale pro práci považují vzorek dat za dostatečný.</i>	
5. Formální úroveň práce	A
<i>Po formální stránce je práce opět bez výhrad. Návaznost praktické části na teoretickou je logická a srozumitelná.</i>	

Závěrečné hodnocení BP*	A
<i>Práce jednoznačně splňuje svoje cíle. Z práce je také zřejmé, že student se o danou problematiku hluboce zajímá a svými znalostmi výrazně převyšuje akademickou úroveň daného tématu. Práce vykazuje známky profesionálního přístupu k tradingu, který lze nabrat jedině praxí, nikoliv pouze nastudováním teorie. Proto k práci nemám žádné výhrady a považuji ji za výbornou.</i>	

* Výsledná známka není aritmetickým průměrem jednotlivých kritérií hodnocení práce.

Otázky k obhajobě:

1. Rozvedte proč jste použil v rámci práce RRR 1:1 a z jakých důvodů jste vybočil mimo market standard?
2. Jak byste upravil svoji strategii při tradingu méně likvidních a více volatilních altcoinů, například Solany nebo SUI?
3. Jak byste upravil Vaši strategii, pokud byste obchodoval s cizími prostředky a měl nastavený jako benchmark například výkonnost BTC/USD, který byste musel překonat?

Práce **splňuje** kritéria pro obhajobu BP. Práci **doporučuji** k obhajobě.

BP byla podrobena kontrole ke zjištění původnosti práce v IS STAG. Na základě výsledků této kontroly bylo zjištěno, že práce **není** plagiát.

Datum 20.05.2024


Podpis vedoucího BP