

Hodnocení vedoucího diplomové práce

Student: Šeda Jan, Bc.

Téma: Algoritmické obchodování na burze s využitím umělých neuronových sítí (id 19333)

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 stavajících, 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 přešel případnému "nestihnutí" dokončení a odevzdání práce v ucelené formě. To se však v rámci běžného termínu nepodařilo. Během června a července student pracoval intenzivně a několikrát svůj postup konzultoval.

4. Aktivita při dokončování

Během červencového dokončování byl student velmi aktivní. Struktura a text práce byl z větší části konzultován. Poznámky vedoucího byly zapracovány. Vzhledem k časové tísní před odevzdáním však vedoucí neměl možnost shlédnout a komentovat celkové dílo (výsledky experimentů a text práce).

5. Publikační činnost, ocenění

Není.

6. Souhrnné hodnocení

dobře (C)

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 řádného odevzdání stoupala aktivita. Nicméně se studentovi nepodařilo odevzdat obhajitelnou práci. V náhradním termínu byla jeho aktivita velmi dobrá. Snažil se odstranit většinu nedostatků. Student s vedoucím své záměry konzultoval. I přes velké nasazení byla práce odevzdána na poslední chvíli s tím, že výsledný text práce neměl vedoucí možnost komentovat.

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

V Brně dne: 10. srpna 2016

.....
podpis