

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Alena Faltysová
Číslo studenta: E190004
Název diplomové práce: Modelování volatility akciových indexů
Cíl práce: Tato diplomová práce se věnuje analýze časových řad se zaměřením na modely volatility. Cílem práce je konstrukce modelů vybraných akciových indexů, které jsou následně využity k predikci budoucího vývoje. Součástí práce je i samotné seznámení s akciovým trhem, akciovými indexy a možnostmi obchodování.
Vedoucí práce: Mgr. David Zapletal, Ph.D.
Studijní program: N0413A050009 Ekonomika management
Akademický rok: 2021/2022

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	☒	☐	☐	☐	☐
Vstupní údaje a jejich zpracování	☐	☒	☐	☐	☐
Použité metody	☒	☐	☐	☐	☐

Kritéria hodnocení práce

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Stupeň splnění cíle práce	☒	☐	☐	☐	☐
Původnost zpracování tématu	☐	☒	☐	☐	☐
Adekvátnost použitých metod	☒	☐	☐	☐	☐
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	☒	☐	☐	☐	☐
Logická stavba práce a rozsah	☒	☐	☐	☐	☐
Práce s českou a zahraniční literaturou včetně citací	☒	☐	☐	☐	☐
Formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	☒	☐	☐	☐	☐
Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie)	☐	☒	☐	☐	☐

Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	☐	☒	☐	☐
Pro praxi	☒	☐	☐	☐

Identifikace záznamu:

Agenda závěrečných prací

.....

Ostatní připomínky k práci

Práce je psána poměrně jasně a srozumitelně bez podstatných chyb a nepřesností. Ocenit je třeba poměrně značné množství ne zcela triviálních teoretických znalostí zejména z oblasti ekonometrie finančních časových řad, které si autorka při psaní textu musela osvojit. Za ocenění také stojí zpětná transformace logaritmických diferencí budoucích předpovědí, včetně jejich intervalů spolehlivosti, na původní hodnoty časových řad.

Vyjádření k výstupům ze systému Theses

Nepovažuji za plagiát, protože nejvyšší míra shody je 6 %.

Otázky a náměty k obhajobě

Je možné říct, zda jsou hodnoty studovaných indexů v poslední době nějak zásadně ovlivněny probíhajícím válečným konfliktem na Ukrajině?

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **A - výborně**

V Pardubicích 18.5.2022

Podpis