

## Posudek vedoucího diplomové práce

Jméno diplomantky	Bc. Michaela Szekeresová
Téma práce	Modelování vývoje vybraných akciových indexů
Cíl práce	Cílem práce je modelování vývoje vybraných akciových indexů pomocí pokročilých metod analýzy finančních časových řad a případná predikce jejich budoucího vývoje s využitím vhodného ekonomického softwaru.
Vedoucí diplomové práce	Mgr. David Zapletal, Ph.D.

náročnost tématu na	úroveň		
	nadprůměrná	průměrná	podprůměrná
teoretické znalosti	x		
praktické zkušenosti		x	
podkladové materiály (vstupní data) a jejich zpracování	x		

kritéria hodnocení práce	úroveň			
	nadprůměrná	průměrná	podprůměrná	nelze hodnotit
stupeň splnění cíle práce	x			
samostatnost při zpracování tématu		x		
logická stavba práce	x			
práce s českou literaturou včetně citací	x			
práce se zahraniční literaturou včetně citací		x		
adekvátnost použitých metod	x			
hloubka provedené analýzy		x		
stupeň realizovatelnosti řešení				x
formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	x			
stylistická úroveň	x			
nároky DP na podkladové materiály, konzultace, průzkumy...	vysoké	průměrné	nižší	nejsou
	x			
použití analýz, matematických, statistických a jiných metod, komparací apod.	ve velké míře	přiměřené	částečné	absentuje
	x			
využitelnost námětů, návrhů a doporučení k řešení problému	ve větší míře	částečná	nižší	nevyužitelnost
		x		
obsah a relevantnost příloh v textu či příl. části DP (tabulky, grafy, propočty apod.)	vysoce funkční	funkční	méně funkční	neuspokojivé
		x		

### Připomínky a otázky k obhajobě:

Práce je psaná vcelku jasně a srozumitelně, řazení kapitol je logické a přispívá k přehlednosti práce. V práci jsou zpravidla vhodně zařazeny tabulky a grafy. Ocenit lze zejména představení a aplikaci poměrně netriviálních metod analýzy finančních časových řad (Boxova-Jenkinsonova metodologie, modely volatility) obsažených ve druhé a čtvrté kapitole. V práci lze ovšem nalézt několik zejména formálních nedostatků. V části 4.1 jsou nesprávně popsány obr. 23 – 25, stejně jako poslední sloupec tabulky 14. Na str. 38 ve vzorci (18) je nesprávný index v sumaci.

U obhajoby autorku žádám, aby uvedla, zda a případně jakým způsobem mohou být akciové indexy využity k obchodování drobnými investory.

**Práce je doporučena k obhajobě**

**Navržený klasifikační stupeň:**

výborně minus
---------------

**Vedoucí diplomové práce:**

Jméno, tituly: Mgr. David Zapletal, Ph.D.

Podpis:

V Pardubicích dne 26. 5. 2016