

Hodnocení vedoucího bakalářské práce

Autor/Autorka

Zuzana VĚTROVSKÁ

Název práce

Technická analýza při obchodování s ropou

Studijní obor

Matematika a finanční studia

Vedoucí práce

Ing. Patrice MAREK, Ph.D.

Splnění cílů práce:

nadstandardně velmi dobře splněny s výhradami nebyly splněny

Odborný přínos práce:

nové výsledky netradiční postupy zpracování výsledků z různých zdrojů shrnutí výsledků z různých zdrojů bez přínosu

Matematická (odborná) úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu přiměřený počet méně podstatné, větší množství podstatnější, větší množství závažné

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Přístup autora k řešení práce, spolupráce s vedoucím práce:

samostatná práce s výbornou komunikací pečlivá práce, drobné zásahy vedoucího pečlivá práce, podstatnější zásahy horší komunikace špatný přístup k práci

Slovní hodnocení a dotazy:

Předložená práce se zabývá popisem technické analýzy a její aplikací na reálná data při tvorbě a optimalizaci obchodního systému pro obchodování s ropou. Autorka navrhla a otestovala vlastní indikátor založený na alternativním vyjádření ceny ropy pomocí jiných komodit.

Práce je zpracována pečlivě a přehledně. Oceňuji především vytvoření vlastního indikátoru a jeho začlenění do systému.

Práce obsahuje následující chyby a nepřesnosti:

- Zápis některých vzorců v kapitole 2 není přesný, např. (2.1) kde chybí časový index a vysvětlivky jsou rovněž špatně indexovány.
- Parametr indikátoru PSAR byl ponechán na doporučené hodnotě. Bylo by vhodnější ho optimalizovat s celým systémem (str. 26).
- V kapitole 4 by testování normality nemělo být na cenách, ale na výnosnostech. Stejně tak i korelace by měla být počítána na výnosnostech.

Otázky

- Na straně 18 uvádíte, že kontrakt CL1 je po posledním obchodním dnu nahrazen kontraktem CL2. Jsou zde nějaké výraznější skoky v ceně?
- Nebylo by vhodné při zařazení Vašeho vlastního indikátoru do obchodního systému nějaký indikátor odebrat? Pokud ano, tak který a proč.

Navrhuji hodnocení známkou:

velmi dobře

12. 6. 2014, *Patrice MAREK*

