

Hodnocení vedoucího bakalářské práce

Autor/Autorka

Miroslav Řehoř

Název práce

Použití nástrojů technické analýzy na vybraném zahraničním akciovém trhu

Studijní obor

Finanční informatika a statistika

Vedoucí práce

RNDr. Blanka Šedivá, 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 vzhladem 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:

Cílem předložené bakalářské práce bylo seznámit se se základy technické analýzy, vybrat vhodné technické indikátory a na jejich základě vytvořit obchodní systém pro obchodování na akciových trzích. Teoretická část práce, která má z velké části pouze kompilační charakter, je obsažena v prvních pěti kapitolách. Autor zde popisuje základní přístupy k analýze akciových trhů a podrobně se zaměřuje na vybrané nástroje technické analýzy (TA). Z celé škály technických indikátorů byly popsány vybrané čtyři indikátory. Není zcela zřejmé, podle čeho byly tyto indikátory vybírány, neboť indikátor Stochastic je sice popsán, ale v praktické části nevyužíván.

Největší díl vlastní práce autora je soustředěna v praktické části, zde student implementoval vlastní navržený obchodní systém na reálná data. V práci stále chybí vysvětlení, proč byly pro implementaci obchodního systému vybrány právě tyto tři uvedené akciové společnosti. Dále by bylo vhodné doplnit konkrétní vztahy, podle kterých jsou počítány poplatky (viz. str. 37).

Výpočty, které jsou obsaženy v příložených xlsx souborech, jsou často zbytečně komplikované a pro pochopení jednotlivých vazeb je třeba věnovat velkou pozornost podrobnému rozboru jednotlivých funkcí. Soubor BP_PEP při otevírání odkazuje na externí zdroj, který není dostupný. Je také otázkou, zda zvolená metoda optimalizace parametrů byla vhodná. Při změně parametru Interval u akcie MCD na hodnotu 20 bylo například dosaženo ročního zhodnocení 10,63%.

Student vyžadoval

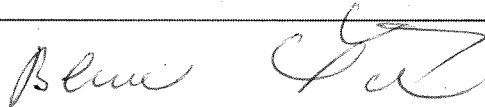
Otázky k obhajobě:

1. Podle jakých kritérií byly vybrány tři analyzované akcie, v čem se vývoj cen akcií ve sledovaném období shodoval a v čem se lišil?
2. Vysvětlete přesněji, co znamená Vaše vyjádření „brali jsme v úvahu sekvenčně vždy zajímavé výsledky u příslušného indikátoru“ (strana 38) ?

Navrhuj hodnocení známkou:

DOBŘE

Datum, jméno a podpis:



17.9.2015