

## Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Kateřina Šindelková  
Číslo studenta: E15915  
Název diplomové práce: Predikce volatility na kapitálových trzích pomocí analýzy sentimentu  
Cíl práce: Predikce volatility na kapitálových trzích v USA pomocí analýzy sentimentu novinových článků  
Vedoucí práce: doc. Ing. Petr Hájek, Ph.D.  
Studijní program: Ekonomika a management  
Akademický rok: 2016/2017

### Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

### Kritéria hodnocení práce

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

### Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Pro praxi	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

## Ostatní připomínky k práci

Práce se zabývá aktuálním tématem, neboť stále častěji se při finančním rozhodování používá analýza nestrukturovaných dat, zejména textu. Autorka postupuje logicky, nejprve popisuje fungování trhu cenných papírů, dále charakterizuje volatilitu aktiv, stručně popisuje teoretická východiska z oblasti psychologie investování a popisuje postup analýzy sentimentu textových dokumentů. Tyto kapitoly jsou velmi přehledné, mohly by ale být podpořeny větším množstvím souvisejících studií. Hlavním přínosem práce je pak sběr dat, jejich předzpracování a návrh a ověření modelu pro predikci volatilitu výnosů pomocí analýzy sentimentu a dalších finančních indikátorů. Celý postup je jasný a dobře odůvodněný. Z formálního hlediska lze práci vytknout několik překlepů.

## Otázky a náměty k obhajobě

1. V rámci obhajoby pojednejte o technických indikátorech používaných pro hodnocení volatilitu ceny akcie.
2. V práci se používá slovníkový (pravidlový) přístup k hodnocení sentimentu novinových zpráv. Uveďte alternativní přístupy k hodnocení sentimentu a porovnejte jejich výhody a nevýhody.

## Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.  
Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **velmi dobře**

V Pardubicích 5.5.2017

Podpis ..... 