

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Eliška Medunová
Číslo studenta: E20736
Název diplomové práce: Analýza a predikce vybraných časových řad
Cíl práce: Tato diplomová práce se věnuje analýze finančních časových řad. Cílem práce je konstrukce modelů vybraných finančních časových řad, které jsou následně využity k predikci budoucího vývoje.
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	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input type="checkbox"/>	<input checked="" 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 type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" 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 type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" 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 type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" 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"/>

Identifikace záznamu:
Agenda závěrečných prací

.....

Ostatní připomínky k práci

V první řadě je třeba poznamenat, že vzhledem k oboru studia autorky a absolvovaným předmětům se jednalo o náročné téma a autorka si musela osvojit značné množství ne zcela triviálních teoretických znalostí zejména z oblasti ekonometrie finančních časových řad. Bohužel z výsledné podoby práce je zřejmé, že ne vždy se to úplně ideálně podařilo a větší pečlivost a zejména časový prostor věnovaný zpracování DP by její finální podobě určitě prospěly.

Odevzdaný text totiž obsahuje celou řadu, většinou formálních, chyb a nepřesností. Zejména se jedná o následující:

- některé v textu uvedené zdroje nejsou zařazeny v seznamu použité literatury (Arlt a kol., 1994, 2002, 2007);
- v textu uvedené odkazy na obrázky jsou často chybné (např. drtivá většina v kap. 4 a další.);
- výstupy ze softwaru Gretl a rovnice modelu uvedené v části 3.1.2 nejsou pro model AR(17), jak uvádí autorka, ale pro model AR(26);
- vyskytuje se řada překlepů i gramatických chyb;
- rovnice (2.10), (2.11) a (2.12) mají jinou velikost než ostatní rovnice;
- některé uvedené věty nedávají smysl;
- vyskytují se odstavce uprostřed vět apod.

Za ocenění naopak stojí zpětné transformace logaritmických diferencí budoucích předpovědí (včetně jejich intervalů spolehlivosti) na původní hodnoty časových řad uvedené v kapitole 4. Je ovšem škoda, že získané predikce nejsou obsáhleji komentovány, ani diskutovány.

Vyjádření k výstupům ze systému Theses

Nejvyšší míra shody, a to 21 %, je s DP s názvem Modelování volatility akciových indexů (autorka: Alena Faltysová, vedoucí: David Zapletal). Vzhledem k tomu, že se jedná o práci na podobné téma, je vyšší míra shody způsobená zejména podobnými metodami použitými k analýze studovaných časových řad. Z tohoto důvodu práci **nepovažuji** za plagiát.

Otázky a náměty k obhajobě

Vzhledem k absenci diskuze získaných výsledků přímo v DP, autorku prosím o jejich zhodnocení a diskuzi při obhajobě práce.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **D**

V Pardubicích 4.1.2023

Podpis