

## Posudek

vedoucího oponenta  
diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Anežka Faltýnková

Název práce: Technická analýza finančních časových řad

Jméno vedoucího/oponenta: Jan Hurt

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji  
uznat jako diplomovou/bakalářskou.

Připomínky a vyjádření vedoucího/oponenta: Téma je zajímavé, totéž se týká i zvolených příkladů, způsob prezentace je však značně nepřehledný s mezerami ve výkladu pro studované metody podstatný.

Str. 5 Tato stránka mohla být vynechána. To, co je v práci prezentováno, se na dané úrovni obejde bez pojmu martingal.

Str. 9 Jaká je motivace pro zavedení splinů?

Str. 11 Jak interpretovat uvedený integrál (vyskytuje se i dále)? Je  $P$  pravděpodobnostní míra?

Str. 13 Co zde znamená „rolování“? Proč se uvažuje denní časové rozpětí 8:00 až 21:50?

Str. 14 Zde je konstatováno, že se nepracuje s rizikově neutrální mírou. S jakou mírou se tedy pracuje? Odečtením průměru se již míra změní na rizikově neutrální?

Str. 16 Jaký je důvod pro takovou volbu  $I$ ? A jaké bylo  $I$  v konkrétních případech?

Str. 19 ř. 13: Odhadují se parametry, a ne modely.

Str. 20 posledních 6 řádků zdola: Nestačily by pouze kubické spliny\_ Proč je počet komponent stanoven na 4?

Str. 29 Proč by se „dala práce rozvinout ve směru nekorelovaných reziduí“?

Místo, datum, podpis vedoucího/opponenta: Praha 10. června 2011, Jan Hurt