

Posudek oponenta bakalářské práce

Autor práce (jméno a příjmení)	Jakub GIERTL
Název práce	Využití korelací na devizovém trhu FOREX
Název a typ studijního programu	Systémové inženýrství a informatika / Bakalářský
Fakulta / katedra	Ekonomická fakulta / KMI
Vedoucí práce	Klicnarová Jana, RNDr. Ph.D.
Oponent	Stanislav Mikeš

Hodnocení práce

1. Význam a náročnost tématu **100 %**
2. Logická struktura práce **75 %**
3. Naplnění cíle práce **75 %**
4. Metodologický postup **100 %**
5. Hodnocení teoretického zobecnění a přínosu **75 %**
6. Praktický přínos práce **50 %**
7. Práce s literaturou **75 %**
8. Formální stránka **50 %**

Závěr

Výsledek: **76.25** bodů

Hodnocení práce známkou: **velmi dobře**

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Po formální stránce mám k práci několik připomínek: vzorce vložené jako obrázky, chybějící odkazování na obrázky a odkazování na literaturu na konci odstavce. Pravopisných chyb není mnoho, ale vyskytují se. Použité formulace a nejasná/vágní vysvětlení v některých částech práce ztěžují čitelnost a pochopení, rigoróznější popis by nebyl na škodu. Například u Divergence, Bollinger Bands, ATR by mohl být přesnější popis, případně vzorec výpočtu. Dále obzvláště popis vstupu/výstupu do/z pozic by zasloužil býti podrobnější, z uvedeného bych nebyl schopen test zopakovat. V přílohách mohl být v tabulkách i sloupec zisk/ztráta a uvítal bych poznámku, co znamená potvrzení. U korelace měnového páru není uvedeno za jak dlouhé období je počítána.

Autor v práci ukázal, že při využití korelace mezi měnovými páry se mu podařilo během testu v daném období dosáhnout vyššího zisku než by dosáhl bez využití korelace. Pro přesnější vyhodnocení úspěšnosti by bylo ale třeba provést více testů v různých obdobích. K tomu by se hodila možnost simulace automatického obchodování, ke které by ale bylo nutné mít objektivně a přesně formulované signály pro vstup a výstup do/z pozice, včetně SL a TP. To podle mého ale přesahuje rozsah

bakalářské práce.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Jak jsou určeny úrovně Stop Loss a Take Profit? Pomocí Pivot Points?
V příloze C je u čtyř obchodů využít Stop Loss; je zde použitý Trailing SL?

Do jaké míry je vstup/výstup do/z pozic subjektivní - probíhal test automaticky? Pokud ne, daly by se tyto signály objektivně formulovat pro případné automatické obchodování?

S tím souvisí otestování na historických datech (jiné období roku, 2, 5, 10 let zpět).
Jak náročné by bylo provést tyto testy?

Datum: 16.05.2014

Podpis oponenta bakalářské
práce