

POSUDEK OPONENTA DIPLOMOVÉ PRÁCE

Student: Bc. Petr Kostelanský

Oponent: Ing. Petr Doležel, Ph.D.

Studijní program: **Inženýrská informatika**

Studijní obor: **Informační technologie**

Akademický rok: **2012/2013**

Téma diplomové práce: **Automatické obchodní systémy**

Hodnocení práce:

Diplomant ve své práci detailně popsal základní strategie technické analýzy pro obchodování s měnovými páry. Teoretickou část považuji za poučnou a přínosnou pro každého začínajícího obchodníka. Diplomant v ní přehledně a správně informuje o různých přístupech k obchodování. V praktické části pak diplomant navrhl a implementoval řešení, které také otestoval na historických datech.

Po formální stránce neshledávám žádné závažné problémy. Pouze bych vytkl několik gramatických chyb. Chybí mi také podrobnější popis nastavení simulace (např. volba časového rámce). Při aplikaci algoritmů bych vytkl nízký počet uskutečněných obchodů během roku.

Otázky k obhajobě:

- 1) Co znamená pojem Trailing Stop a jak se využívá?
- 2) Jaký časový rámec je neoptimálnější pro dané algoritmy?
- 3) Zkuste popsat situaci, která nastala 6. září 2011 na měnovém páru EURCHF. Jaký dopad má podobný zásah na trhu co se týče technické analýzy (např. korelace měn)?

Předloženou diplomovou práci shledávám jako velmi zajímavou a přínosnou. Je zřejmé, že žádný automatický obchodní systém nemůže být vždy výnosný a absolutně spolehlivý. Diplomantem navržené algoritmy v dlouhodobém měřítku pracují spolehlivěji než běžné algoritmy založené na metodách MACD nebo Moving Average.

Celkové hodnocení práce:

Známku uvede oponent dle svého uvážení dle klasifikační stupnice ECTS:

A – výborně, B – velmi dobře, C – dobře, D – uspokojivě, E – dostatečně, F – nedostatečně.

Stupeň F znamená též „nedoporučuji práci k obhajobě“.

**Předloženou diplomovou práci doporučuji k obhajobě a navrhuji hodnocení
B - velmi dobře.**

V případě hodnocení stupněm „F – nedostatečně“ uveďte do připomínek a slovního vyjádření hlavní nedostatky práce a důvody tohoto hodnocení.

Datum 30.5.2013

Podpis oponenta diplomové práce

