



## POSUDEK VEDOUCÍHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

**Jméno studenta:** Pavel Stříteský

**Název práce:** Intradenní obchodování na trhu FOREX

**Autor posudku:** Ing. Ivan Soukal, Ph.D.

**Cíl práce:** Testovat obchodní strategie využívající zejména technickou analýzu na devizovém trhu. Dále posoudit jednotlivé obchodní přístupy a metody a také formulovat doporučení pro obchodníky.

Povinná kritéria hodnocení práce	Stupeň hodnocení (známka)					
	A	B	C	D	E	F
Práce svým zaměřením odpovídá studovanému oboru	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vymezení cíle a jeho naplnění	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Zpracování teoretických aspektů tématu	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Zpracování praktických aspektů tématu	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Adekvátnost použitých metod, způsob jejich použití	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka a správnost provedené analýzy	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Práce s literaturou	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Logická stavba a členění práce	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Jazyková a terminologická úroveň	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Formální úprava a náležitosti práce	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vlastní přínos studenta	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Využitelnost výsledků práce v teorii (v praxi)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

### Vyjádření k výsledku anti-plagiátorské kontroly

Práce byla vyhodnocena v Odevzdej.cz (celková podobnost 1%). Práce není plagiátem.

### Dílní připomínky a náměty:

K obsahové stránce je námětem, že autor měl zdrojem podepřít svou volbu velikosti spreadu, která do značné míry předurčí úspěšnost testovaných variant. Ostatní náměty jsou okrajového charakteru. U některých podkapitol se mohl autor opřít o více zdrojů, např. 3.1 a 3.2. Tvzení, že IMS patří mezi obchodní systémy, které jsou více volatilní a z krátkodobého hlediska není zaručena jeho ziskovost, je matoucí. Žádný systém nemá zaručenou ziskovost. Lze se pouze bavit o pravděpodobnostech s tím, že existuje závislost mezi ziskovostí a časovým horizontem v závislosti na volatilitě. Přesto nutno podotknout, že drtivá většina podobných úvah nebere v potaz náklad obětované příležitosti, což by procento ziskových mohlo dále snížit. Uvedení výsledků v pipech mohlo být přepočteno při známosti časové řady bid/ask a velikosti portfolia do dolarů.

K formální stránce nejsou náměty.

**Celkové posouzení práce a zdůvodnění výsledné známky:**

Cíl práce byl splněn. Práce velmi dobře spadá do studovaného oboru. Autor v práci vhodně využil vlastních zkušeností se zkoumanou oblastí a zlepšil během práce vlastní schopnosti obchodníka při programování strategie. K této snaze bylo přihlédnuto jako protivaže k faktu, že představená strategie představuje spíše základ pro tvorbu dalších komplexnějších nástrojů. Autor si je vhodně vědom limitů své strategie. Autor cituje uvedené zdroje, jejich struktura je adekvátní zpracovávanému tématu. Práce je logicky členěna, grafy a tabulky jsou komentované a je přiložen jejich seznam.

Předložená práce splňuje požadavky na ni kladené po stránce formální i obsahové. Vzhledem k výše uvedenému navrhuji hodnocení A.

**Otázky k obhajobě:**

O jaký ukazatel by při případném pokračování systém CROSS autor obohatil?

**Práci doporučuji k obhajobě.**

**Navržená výsledná známka: A**

**V Hradec Králové, dne 1. září 2018**

---

**podpis**