



**SLEZSKÁ
UNIVERZITA**

OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

SEMINÁRNÍ PRÁCE

- Píše se v průběhu semestru ve dvojicích, žádná dvojice nesmí mít stejná data!
- Skládá se z 5 částí, hodnocených rovnoměrně po 4 bodech. Rozsah práce se přizpůsobí jejímu obsahu. Termín odevzdání do systému ve WORDU přes Odevzdávárnu je 6/12/2021 do 23:59! Poté žádná práce již nebude akceptována.
- Součástí je samozřejmě úvodní strana, Wordem vygenerovaný obsah, stručný Úvod a Závěr! (zdroje jsou pro všechny společné, liší se pouze data)
- Části jsou:
 - o **ÚVOD&ZÁVĚR**
Stručné představení indexu a vybraných titulů, doplněné o grafy vývoje výnosů na akcii za sledované období v absolutních hodnotách, i v tempch růstu pro oba tituly.
 - o **KORELACE**
Zkoumání korelací mezi vybranými časovými řadami (vyloučení 1 proměnné).
 - o **STACIONARITA**
Zkoumání stacionarity vybraných časových řad (ADF).
 - o **KOINTEGRACE**
Dlouhodobá vazba vybraných akciových titulů a jejich indexu (Johansenův test).
 - o **KAUZALITA**
Krátkodobá vazba vybraných akciových titulů a jejich indexu (Grangerův test).
 - o **REGRESNÍ ANALÝZA**

Do PONDĚLÍ 4. 10. 2021 mi jeden z dvojice pošle E-mail, který bude obsahovat tyto údaje:

- **Jméno a Příjmení** obou členů dvojice.
- **Název (zkratku) akciového indexu**, který jste si vybrali, vč. URL adresy.
- **Jména DVOU akciových titulů**, jež jsou v tomto indexu obsaženy, vč. URL.
- **INTERNETOVÉ ADRESY všech** akciových titulů přidejte tedy do znění E-mailu!

KOMU NA JEHO MAIL NEODPOVÍM, má zadání práce schváleno!! Pokud se budete shodovat se zadáním, které si již vybral někdo jiný, obratem Vám odpovím a budete si moci zvolit jiný akciový titul.

Společný zdroj: Finanční databáze YAHOO; URL: <http://finance.yahoo.com/>

Ing. Tomáš Heryán, Ph.D.