



**SLEZSKÁ
UNIVERZITA**

OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

SEMINÁRNÍ PRÁCE

- ✓ Píše se v průběhu semestru ve dvojicích, žádná dvojice nesmí mít stejná data!
- ✓ Skládá se VŽDY z částí popsaných níže. Rozsah práce se přizpůsobí jejímu obsahu. Termín odevzdání do systému ve WORDU přes Odevzdávárnu Neděle 15/12/2024 do 23:59! Poté žádná práce již nebude akceptována.
- ✓ Součástí je samozřejmě úvodní strana, Wordem vygenerovaný obsah, Úvod a Závěr! Zdroje jsou pro všechny společné, liší se pouze data, NECHCI ŽÁDNOU TEORII.

Části jsou:

- ✓ **ÚVOD&ZÁVĚR**
Stručné představení indexu a vybraných titulů, doplněné o grafy vývoje výnosů na akcii za sledované období v absolutních hodnotách, i v tempech růstu pro oba tituly.
- ✓ **KORELACE**
Zkoumání korelací mezi vybranými časovými řadami (vyloučení 1 proměnné).
- ✓ **STACIONARITA**
Zkoumání stacionarity vybraných časových řad (ADF).
- ✓ **KOINTEGRACE**
Dlouhodobá vazba vybraných akciových titulů a jejich indexu (Johansenův test).
- ✓ **KAUZALITA**
Krátkodobá vazba vybraných akciových titulů a jejich indexu (Grangerův test).
- ✓ **REGRESNÍ ANALÝZA**

Do ÚTERÝ 15. 10. 2024 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: [ZDE](#) (Markets/Indices/Major Indices)

[Ing. Tomáš Herván, Ph.D.](#)