



**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 17/12/2023 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 19. 10. 2023 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 Herván, Ph.D.](#)*