

Posudek vedoucí na bakalářskou práci

D o m i n i k y K o l l á r o v é

P A R A M E T R I C K É T E S T O V A N I E N E L I N E A R I T Y

V Č A S O V Ý C H R A D Á C H

Tématem bakalářské práce je speciální problematika analýzy časových řad. Cílem bylo rozšířit znalosti posluchačky v této oblasti a pokusit se o aplikaci nastudovaných postupů na reálná data. Autorka v teoretické části práce zpodrobnila popis vybraných testů nelinearity vzhledem ke zdrojové literatuře, zejména rozepsáním maticových tvarů modelů a použitím teorie testování submodelů v lineárním modelu. Za další individuální přínos lze považovat praktickou část. Ta obsahuje simulační studii zaměřenou na porovnání shody empirického a teoretického rozdělení testových statistik a následně zpracování dvou sad reálných dat, které lze považovat za ukázkou přínosnou pro finančně-matematickou praxi.

Text práce je psán ve slovenském jazyce, přehledně a srozumitelně. Neobsahuje zásadní věcné ani tiskové chyby, stylistická úroveň a grafická úprava jsou kvalitní. Použité zdroje jsou důsledně citovány. Studentka prokázala schopnost seznámit se s teoretickými partiemi. Pro realizaci praktické části používala různé typy softwaru (R, Mathematica). Splnila zadání práce, při její tvorbě pracovala iniciativně a se zájmem o zvolenou problematiku.

Domnívám se, že předložená práce splňuje všechny náležitosti k tomu, aby byla uznána jako bakalářská.

V Praze 28.8.2018

RNDr. Jitka Zichová, Dr.