

Posudek vedoucího diplomové práce

Kateřiny Voňkové

### **Aplikace Whiteova testu pro robustní odhadz WLS a LWS**

Autorka poněkud pozměnila původní záměr diplomové práce a třeba říci, že vynalézavým způsobem. Aplikace Whiteova testu je opravdu originální a většina postupů autorkou navržených může být funkční (chtělo by to ale patrně rozsáhlé simulace). Zpracování práce je poměrně pečlivé, ač autorka přišla všehovšudy dvakrát na konzultaci a práci psala na poslední chvíli.

Text práce prokazuje, že se autorka seznámila s myšlenkami robustnosti daleko nad rámec vykládaný v regresní analýze na naší fakultě. To, co v práci poněkud postrádám (a co jsem už nestačil korigovat, neboť jsem viděl před svým nástupem do nemocnice jen první draft práce), je obšírnější motivace půro autorkou navržené postupy, motivace z oblasti ekonomie.

Autorka práce je nepochybně velmi schopná, rychle se seznamuje s novými pojmi a souvislostmi. Navržené postupy korekce heteroskedasticity jsou originální a jak jsem již předeslal, většina z nich má dobrou šanci býti funkční. Navrhuji, aby práce byla uznána jako diplomní a oceněna jako **velmi dobrá**.

Prha 25. 6. 2007

