

POSUDEK VEDOUCÍ DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Pravděpodobnostní předpověď v modelech exponenciálního vyrovnávání
Autor: Bc. Barbora Viskupová

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce se zabývá metodami exponenciálního vyrovnávání a zasazuje je do kontextu specifických stavových modelů. Zaměřuje se na aditivní modely, pro něž je popsáno několik různých přístupů ke konstrukci předpovědních intervalů. Jmenovitě jsou zde odvozeny tradiční analytické vzorce a představeny jsou simulační přístupy. V praktické části jsou následně tyto metody porovnány pro několik různých scénářů. Práce obsahuje též aplikaci na reálná data.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Barbora Viskupová pracovala na své práci aktivně a samostatně. Prokázala pochopení dané tematiky jak z teoretického hlediska tak i z praktického, kdy představené metody prakticky implementovala.

Téma práce. Téma práce je dle mého názoru velmi aktuální. Vychází z metod, které jsou standardní a jsou vyučovány v předmětu Časové řady, ale přistupuje k nim jako ke speciálním stavovým modelům, které následně umožňují statistickou inferenci. Předložené zpracování splňuje zadání práce, nicméně téma bylo možné rozpracovat ještě i více do hloubky, např. o další zobecnění v simulačních přístupech apod.

Vlastní příspěvek. Vlastní příspěvek autorky spočívá ve srozumitelném představení zkoumané metodologie a zejména pak v praktické studii, kdy zkoumala chování představených metod pro několik různých scénářů. Jednoduše zvolený model ji umožnil porovnat výsledky se skutečností a vyhodnotit kvalitu konstruovaných předpovědních intervalů. Tyto poznatky pak využívá v analýze reálných dat v závěru práce.

Matematická úroveň. Matematická úroveň práce je dobrá. Autorka se snažila srozumitelně rozepisovat a odvozovat veškeré uváděné vzorce, a to i se zdůvodněním.

Práce se zdroji. Použité zdroje jsou řádně citovány.

Formální úprava. Po formální stránce jsem s prací spokojená.

ZÁVĚR

Předloženou práci doporučuji uznat jako diplomovou.

Šárka Hudecová
KPMS MFF UK
V Praze dne 26. srpna 2020