

Zápis z obhajoby doktorské disertační práce RNDr. Miriam Marušiakové „Tests for Multiple Changes in Linear Regression Models“

Obhajoba se konala před komisí **4 m-5 Ekonometrie a operační výzkum** dne 14. prosince 2009 v 15.30 na MFF UK, Sokolovská 83, Praha 8, posluchárna KPMS.

Předsedkyně komise: Prof. RNDr. J. Dupačová, DrSc. (MFF UK)

Přítomní členové komise: Doc. RNDr. Z. Prášková, CSc. (MFF UK)

Prof. RNDr. J. Antoch, CSc. (MFF UK)

Prof. RNDr. J.A. Víšek, CSc. (FSV UK)

Doc. RNDr. J. Pícek, CSc. (TU Liberec)

Doc. P. Volf, CSc. (ÚTIA AV ČR)

Oponenti:

Doc. RNDr. Z. Prášková, CSc. (MFF UK)

Doc. RNDr. J. Pícek, CSc. (TU Liberec)

Hosté: Prof. RNDr. Marie Hušková, DrSc. – školitelka, Mgr. K. Vaníček – zapisovatel

Předsedkyně komise představila doktorandku RNDr. Miriam Marušiakovou a seznámila přítomné s jejím životopisem, seznamem publikací a studijními pobyty v zahraničí. Bylo konstatováno, že doktorandka splnila všechny podmínky nutné pro obhajobu, k práci nedošly žádné připomínky. Školitelka Prof. RNDr. M. Hušková, DrSc. informovala o průběhu studia doktorandky a její akademické činnosti. Stručně také popsala východiska a cíle, zhodnotila náplň disertační práce i aktivní přístup doktorandky. Poté RNDr. Miriam Marušiaková ve svém vystoupení seznámila přítomné s obsahem své práce a hlavními výsledky. Popsala základní studované modely lineární regrese a jejich modifikace (bez trendu, s trendem, autoregresní modely, nezávislé a závislé chyby/rezidua, robustní M-odhady, α -mixing modely), které poté aplikovala jak v rámci simulací tak v rámci praktických aplikací. Hlavním teoretickým výsledkem je odvození testovacích statistik a kritických hodnot pro detekci vícenásobných změn regresních parametrů pomocí permutačních statistik reziduí v kombinaci s bootstrap metodou. V simulační části doktorandka porovnávala sílu jednotlivých testovacích statistik. Výsledky byly názorně prezentovány pomocí QQ a SPC grafů. V aplikační části byly teoretické poznatky aplikovány na data popisující globální teplotu v historickém časovém rozmezí 150 let. Oponentka Doc. RNDr. Z. Prášková, CSc. seznámila přítomné se svým oponentským posudkem. Ocenila přínos a přehlednost práce a dosažené teoretické výsledky. Položila několik dodatečných dotazů. Předloženou práci doporučila přijmout k obhajobě. Oponent Doc. RNDr. J. Pícek, CSc. ocenil jedinečný přínos práce i její zpracování a doporučil práci k obhajobě. Ve veřejné rozpravě následovalo několik doplňujících dotazů. Doktorandka doplnila svou prezentaci o odpovědi na závažnější otázky. Oba oponenti vyjádřili s odpověďmi spokojenost.

V neveřejné části obhajoby proběhlo tajné hlasování s tímto výsledkem:

počet členů s hlasovacím právem: 6

počet přítomných členů s hlasovacím právem: 6

odevzdáno kladných hlasů: 6

odevzdáno záporných hlasů: 0

odevzdáno neplatných hlasů: 0

Závěrečné stanovisko komise: Bylo konstatováno, že práce splňuje požadavky kladené touto fakultou na doktorskou disertační práci, a proto komise uděluje RNDr. Miriam Marušiakové titul Ph.D. v oboru Ekonometrie a operační výzkum.

V Praze dne 14. prosince 2009

Zapsal: K. Vaníček

P

pi

bu