

Posudek vedoucího diplomové práce
Magdalena Komzáková:
Zdánlivá regrese ekonomických ukazatelů

Práce zhrnuje výsledky vztahující se k fenoménu „zdánlivá regrese“.

Autorka nejdříve uvádí definice základních pojmů, které jsou nutné k pochopení studované tematiky. Definuje například stacionaritu, ergodicitu, procesy MA, AR a ARMA. Uvádí také nestacionární procesy, zejména procesy s deterministickým trendem, procesy se stochastickým trendem; ARIMA, SARIMA.

Třetí kapitola je věnována integrovanosti, kointegrovanosti procesů a zejména vlastnímu tématu práce, zdánlivé regresi. Uvádí kritérium pro rozpoznání zdánlivé regrese. Také cituje prameny, které ukazují, že zdánlivá regrese není jev způsobený nedostatkem pozorování. Naopak, lze ukázat, že uvedený paradox se objevuje při libovolném počtu dat a ani v limitě nezmizí. Jsou zde také uvedeny metody, jak se zdánlivé regresi vyhnout. Jsou uvedeny dva přístupy. Jednak zahrnout do regresního modelu také diference sledovaných ukazatelů, jednak použít regresní model pro diference sledovaných ukazatelů.

Poslední kapitola je věnována rozpoznání zdánlivé regrese. Jsou zde uvedeny statistické testy pro existenci jednotkového kořene autoregresního polynomu, stacionarity a testy kointegrovanosti náhodných ukazatelů.

Práce je doplněna studií závislosti mezi indexy dovozních a vývozních cen České republiky. Jsou použita data od ledna 2001 do ledna 2006.

Diplomantka pracovala na práci samostatně a pilně. Samostatně zjistila řadu pramenů vztahujících se k tématu. Zpracovala je v jednotný a přehledný text, což je hlavním přínosem diplomantky. Práce podává ucelený přehled o zadané problematice.

Doporučuji proto, aby předložená práce byla uznána za práci diplomovou.

V Praze 1.května 2006



Doc. RNDr. Petr Lachout, CSc.