

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

~~Autor~~/Autorka: Kristýna Bílková

Název práce: Logistická regrese s aplikacemi ve finančním sektoru

Jméno ~~vedoucího~~/oponenta: RNDr. Michal Pešta, Ph.D.

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji

uznat jako ~~diplomovou~~/bakalářskou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření ~~vedoucího~~/oponenta:

Bakalářska práca je veľmi peknou a netriviálnou kompiláciou na tému binárnej logistickej regresie. Autorka do značnej miere čerpala z knihy Hosmer & Lemeshow (2000), čo však nijako neznižuje kvalitu práce, pretože študentka pochopila veľmi náročnú problematiku do detailov a navyše dokázala zhrnuté teoretické poznatky komplexne aplikovať na poisťovnícke dáta pomocou softwaru SAS. Najviac oceňujem prevedené diagnostiky, diskusiu a interpretácie v praktickej časti práce.

Otázky:

- Strana 24: Nebolo by vhodnejšie písať nad g_1 a g_2 striežku, keď sa už v tomto momente na pravej strane rovností vyskytujú odhady parametrov?
- Nech máme tri inklúzne binárne logistické modely: model M_0 ; jeho podmodel M_1 , ktorý má o jeden parameter (pre jednoduchosť ho označme β_1) menej než M_0 ; a podmodel M_2 modelu M_1 , ktorý má o jeden parameter (β_2) menej než model M_1 . Môže nastať situácia, že na základe Waldovej štatistiky nezamietneme nulovosť β_1 a následne i β_2 , ale zároveň zamietneme na základe štatistiky G (rozdiel „Deviance“ modelov M_2 a M_0), že β_1 a β_2 sú nulové?

Miesto, datum, podpis ~~vedúceho~~/oponenta:
V Prahe 20. 6. 2012

RNDr. Michal Pešta, Ph.D.