

## Hana Tritová: Maximálně věrohodné odhady v časových řadách

Předložená bakalářská práce se zabývá maximálně věrohodným odhadem a jeho použitím při odhadování parametrů základních typů časových řad. Je členěna do čtyř kapitol. V první kapitole studentka čtenáře seznámí se základními pojmy jako maximálně věrohodný odhad, posloupnost klouzavých součtů, autoregresní model a jejich kombinace. Druhá kapitola je věnována odvození věrohodnostních funkcí a následných maximálně věrohodných odhadů parametrů všech zmíněných typů časových řad. Ve třetí kapitole jsou pak uvedeny další možné odhady parametrů a to metoda momentů a metoda nejmenších čtverců. Čtvrtá kapitola obsahuje konkrétní příklady, na nichž je ověřena kvalita všech tří odhadů v závislosti na různé volbě parametrů. Práce je opatřena závěrem, v němž studentka shrnula cíle své práce.

Práce je napsána přehledně, je dobře strukturovaná a je zřejmé, co bylo studentčiným záměrem. Neobsahuje žádné typografické ani gramatické chyby, ojediněle se objevila mírně nejasná stylizace. Studentka se seznámila s jistým rozšířením teorie časových řad nad rámec látky probírané ve třetím ročníku a prokázala schopnost práce s výpočetními programy.

Práce neobsahuje faktické chyby a mám k ní jen pár drobných poznámek:

- str.4: Časová řada není posloupností pozorování ale náhodný proces.
- kap.4: Chybí zdroj dat použitých k výpočtům. Není zřejmé, zda je studentka sama nasimulovala, či použila nějakou sadu dat.
- kap.4: Práce udává jakýsi základní přehled o používaných pojmech, proto by, přestože se jedná o dobře známý pojem, možná bylo dobré uvést, jak je definována střední kvadratická chyba, skrze niž jsou odhady porovnávány.

Tyto připomínky nepovažuji za nijak zásadní a práci hodnotím jako velmi dobrou a **doporučuji ji uznat jako bakalářskou práci na MFF UK**. Hodnocení přikládám na zvláštním papíře.

V Praze 30.8.2011

Mgr. Markéta Zikmundová

Bakalářskou práci navrhuji hodnotit známkou 1.