

Název práce: Studium závislostní struktury v ekonomických a finančních datech

Autor: Radana Hlavandová

Katedra: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí bakalářské práce: RNDr. Jitka Zichová, Dr., Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Abstrakt: Práce se zaměřuje na problematiku grafických modelů, jakožto možného nástroje pro určování vztahů mezi různými veličinami. Poskytuje široký teoretický základ pro dvě metody testování dat, test nulovosti parciálních korelačních koeficientů a test založený na věrohodnostním přístupu, který ověřuje shodu grafického modelu s daty na základě deviance. V práci je popsána teorie grafů podmíněných nezávislostí a Markovských vlastností jako podklad pro oba testy, které jsou ilustrovány na obecných příkladech a na příkladu s reálnými finančními daty.

Klíčová slova: parciální korelační koeficienty, graf podmíněných nezávislostí, grafické model