

Posudek vedoucí na bakalářskou práci

Marka Rathouského

AUTOREGRESNÍ MODEL Y

Autoregresní procesy patří k široce využívaným nástrojům v analýze časových řad, které představují pozorované realizace spojitých náhodných veličin. Méně známé jsou autoregresní modely pro diskrétní časové řady. Cílem práce bylo nastudovat a popsat oba typy modelů včetně různých způsobů odhadování parametrů, v diskrétním případě podrobně odvodit momentovou strukturu a prakticky zkoumat chování modelů a odhadových procedur prostřednictvím simulační studie. Toto zadání bylo posluchačem splněno. Výsledkem je přehledně a srozumitelně sepsaný text se třemi teoretickými a jednou simulační kapitolou.

Práce je psána ve slovenském jazyce, neobsahuje závažné věcné ani tiskové chyby. Její matematická úroveň odpovídá požadavkům na bakalářské práce kladeným, grafická úprava je kvalitní. Použité zdroje jsou řádně citovány v úvodu práce. Autor prokázal schopnost nastudovat teoretické partie, samostatně provést jednoduchá odvození a naplánovat a realizovat simulační experiment s použitím vhodného softwaru. Na zadaném tématu pracoval iniciativně a se zájmem. Doporučuji, aby předložená práce byla přijata jako bakalářská.

V Praze 28.8.2017

RNDr. Jitka Zichová, Dr.