

POSUDEK VEDOUCÍHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Statistická inference v modelech s proměnlivými koeficienty

Autor: Martin Splítek

SHRnutí OBSAHU PRÁCE

Autor sa v práci venuje regresným modelom s premenlivými koeficientami. Hlavná časť práce je venovaná základnému súhrnu známych teoretických výsledkov a inferenčných nástrojov v týchto modeloch (kapitoly 1–3). V Kapitole 4 autor prezentuje stručnú polemiku na možný algoritmický postup pri výbere premenných a budovaní finálneho modelu.

V praktickej časti práce, v piatej kapitole, autor uvádza simulačnú štúdiu a porovnáva skutočnú empirickú hladinu a silu niektorých testov diskutovaných v teoretickej časti. Navrhnutá simulačná štúdia ale zbytočne pracuje s príliš jednoduchými a v praxi málo uplatniteľnými modelmi. V závere kapitoly je model s premenlivými koeficientami aplikovaný na reálny príklad, avšak opäť len v minimálnom rozsahu a bez náležitej analýzy/diskusie.

Práca je na rozdiel od svojej predchádzajúcej verzie doplnená a simulačnú štúdiu s empirickým porovnaním niektorých uvedených testov. Autor zároveň odstránil viaceré chyby, nedostatky a nesprávne formulácie a zapracoval niektoré dôležité pripomienky oponenta. Iné však vyriešil iba jednoduchým odstránením problematickej pasáže textu.

Autor pracoval samostatne, bohužiaľ však v niektorých ohľadoch na škodu veci: prácu považujem za priemernú a výčítam jej hlavne príliš zjednodušujúci prístup autora a iba minimálnu vôľu efektívne riešiť vzniknuté problémy. V niektorých smeroch práca pôsobí neucelene a zbytočne triviálne, často bez potrebného kontextu. Celkovo si ale myslím, že spĺňa podmienky kladené na záverečnú prácu a doporučujem ju komisii uznať ako diplomovú prácu.

V Prahe, 11.01.2018


RNDr. Matúš Maciak, Ph.D.
maciak@karlin.mff.cuni.cz