

## **Posudek vedoucího bakalářské práce**

**Jakub Jelenčíak:**

### **Vektorová autoregrese**

Cílem bakalářské práce je popsat jak to teoretické, tak po praktické a aplikační stránce jeden z nejpoužívanějších modelů vícerozměrných časových řad.

Autor se nejprve adekvátním způsobem vyrovnal v kap. 1 a 2 s popisem základních principů modelování vícerozměrných časových řad. V kap. 3 se věnuje vlastnímu modelování v rámci vektorové autoregrese včetně obvyklých aplikačních výstupů (což je zde především kauzalita). Konečně v kap. 4 vše demonstruje na vhodných příkladech s reálnými daty. Autor musel zvládnout netriviální teorii (rozsáhlá monografie *Lütkepohl, H. (2005). New Introduction to Multiple Time Series Analysis*) a zorientovat se v softwarové nabídce pro uvažovaný typ modelů.

Výklad má logickou strukturu a grafická úprava práce je solidní. Autor pracoval samostatně a velmi iniciativně. Úroveň práce převyšuje standard požadovaný od bakalářských prací, neboť se týká problematiky přednášené až v rámci magisterského studia.

Na základě předchozích skutečností doporučuji, aby předložená práce byla uznána jako práce bakalářská.

12. 5. 2022

Prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc.