

Posudek vedoucího diplomové práce

Bejda, P.:

Diskrétní a omezené vysvětlované proměnné v ekonometrii

Předložená diplomová práce se zabývá důležitou oblastí současné ekonometrie, a to modely, jejichž vysvětlované proměnné mají diskrétní charakter (např. binární proměnné) či podléhají určitému typu omezení (např. cenzorované proměnné). Takové situace jsou v ekonometrické praxi velmi časté a odpovídající modely umožňují elegantně provádět důležité ekonometrické analýzy (např. konstrukce předpovědí, vyšetřování doby trvání).

Práce postupně probírá jednotlivé typy takových vysvětlovaných proměnných nejen teoreticky, ale doplňuje existující software (především EViews, ale také systém R) o některé důležité postupy, které zde nejsou implementovány a jsou navrženy autorem na základě jeho praktických výpočtů (např. posouzení předpovědních schopností modelu pomocí metody jack-knife či s využitím testovací množiny vybírané prostým náhodným výběrem, graf odhadu podmíněné pravděpodobnosti, praktická implementace situace, kdy se vyšetřuje proměnná vyjadřující dobu trvání). Tyto doplňky vyžadovaly nejen teoretické zvládnutí dané problematiky, ale také značný kus náročné programátorské práce.

Nedílnou součástí práce jsou příklady s reálnými daty, která autor buď převzal z literatury (kde byly ovšem uvedeny v jiném kontextu) a nebo si je vlastním úsilím opatřil z praxe. Je nutné konstatovat, že provedené zpracování dat v rámci těchto příkladů patří k profesionálním ekonometrickým analýzám tak, jak by měly opravdu vypadat. Autor posuzuje danou problematiku z různých úhlů, doplňuje zpracování svým vlastním softwarem, tam kde je to dle jeho názoru vhodné, a končí kvalifikovanými závěry.

Diplomant pracoval na předložené práci samostatně a iniciativně. Práce je napsána srozumitelně a má dobrou grafickou úroveň. Autor se navíc nevyhýbal teoretickému podchycení popisovaných problémů. Práce by mohla sloužit jako inspirace pro ty, kteří chtějí aktivně využívat moderní ekonometrické metody s použitím aktuálních softwarových prostředků. Doporučuji uznat ji jako diplomovou práci.

17. 4. 2009

Prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc.