

ERRATA K DIPLOMOVEJ PRÁCI ROBUSTNÍ ODHADY V MODELU CAPM

Str. 6: V treťom riadku zdola v zátvorke nahradzujem slovné spojenie „indexu cenného papiera“ slovným spojením „burzového indexu cenných papierov“.

Str. 8: Vetu „Z obrázku je zrejmé, že smernica dotýčnice v bode M krivky iM sa rovná smernici CML priamky v bode M .“ nahradzujem vetou „Smernica dotýčnice v bode M krivky iM sa musí rovnať smernici CML priamky v bode M .“.

Str. 19: Vo vete 3 v odstavci (1) je chybné uvedení záver tvrdenia v tvare:

$$[var\mathbf{b}_1, \dots, var\mathbf{b}_l] = diag(\boldsymbol{\Sigma}) \otimes (\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}.$$

Tento zápis nahradzujem nasledujúcim tvarom:

$$var[\mathbf{b}_1, \dots, \mathbf{b}_l] = diag(\boldsymbol{\Sigma}) \otimes (\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}.$$

Táto oprava sa vzťahuje aj k dôkazu vyššie uvedeného tvrdenia.

Str. 25: Vzorec pre Mahalanobisovu vzdialenosť prevzatý z literatúry [17] je chybný. Správny tvar uvádza literatúra [20]. Preto vzťah:

$$M_i = \left[\sum_{i=1}^n (\mathbf{X}_i - \bar{\mathbf{X}})' \mathbf{S}^{-1} (\mathbf{X}_i - \bar{\mathbf{X}}) \right]^{\frac{1}{2}}$$

nahradzujem nasledujúcim vzťahom:

$$M_i = [(\mathbf{X}_i - \bar{\mathbf{X}})' \mathbf{S}^{-1} (\mathbf{X}_i - \bar{\mathbf{X}})]^{\frac{1}{2}}.$$

Str. 27: Názov definície „Spojitost' funkcionálu“ nahradzujem názvom „Robustná postupnosť“.

Str. 31: V kapitole 4.2.6 nahradzujem:

- zápis $\int_{\mathcal{X}} x dP$ zápisom $\int_{\mathcal{X}} X dP$,
- zápis $\int_{\mathcal{X}} x dP_n$ zápisom $\int_{\mathcal{X}} X dP_n$,
- zápis $\int_{\mathcal{X}} x d((1-t)P + tQ)$ zápisom $\int_{\mathcal{X}} X d((1-t)P + tQ)$ a
- zápis $E_P(x - E_P X)^2$ zápisom $E_P(X - E_P X)^2$.

Str. 40: V prvom odstavci kapitoly 4.4 nahradzujem poslednú vetu „Tento typ odhadu je riešením rovnice:“ vetou „Tento typ odhadu je:“.

Str. 44: Posledný vzťah je uvedený chybné v tvare:

$$T_n = \operatorname{med}_{1 \leq i \leq j \leq n} \left\{ \frac{X_i - X_j}{2} \right\}.$$

Tento vzťah nahradzujem nasledujúcim vzťahom:

$$T_n = \operatorname{med}_{1 \leq i \leq j \leq n} \left\{ \frac{X_i + X_j}{2} \right\}.$$

Všetkým sa ospravedlňujem za vzniknuté chyby.

3. septembra 2012

Bc. Monika Steinhübelová