

Posudek vedoucího na diplomovou práci:

Odhady a testy v modelech panelových dat

autorka: Magdalena Zvejšková

Diplomová práce se týká statistických procedur pro některé modely pro tzv. panelová data. Práce začíná historickým přehledem a vysvětlením základních pojmů pro tuto oblast (kapitola 1). Poté se zaměřuje na popis a studium tzv. poolového modelu (kapitola 2) a modelů komponentních chyb (kapitola 3). Kapitola 4 se věnuje podrobně studiu AR(1)modelů panelových dat s pevným koeficientem a kapitola 5 se zabývá studiem AR(1) modelem panelových dat s náhodnými koeficienty. Jsou konstruovány odhady neznámých parametrů a odvozeny jejich vlastnosti. Navíc jsou navrženy a studovány testy pro ověření vhodnosti modelu. Teoretické výsledky jsou doplněny simulační studií a aplikací na reálná data.

Zatímco první 3 kapitoly jsou zpracovány dle dostupné literatury (hlavně knihy), kapitoly 4 a 5 obsahují též vlastní příspěvky diplomantky.

Diplomantka pracovala velice samostatně a iniciativně. Výsledek práce považuji za velice pěkný. Vlastní zpracování a prezentaci lze jen pochválit. Práci považuji za nadstandardní.

Domnívám se, že práce splňuje požadavky kladené na diplomovou práci a doporučuji ji za ni uznat.

Prof. RNDr. Marie Hušková, DrSc.,vedoucí diplomové práce

12.8.2013