

Posudek oponenta bakalářské práce

Jakub Filka:

Autokorelační a dekompoziční metody v analýze ekonomických časových řad

Předložená práce shrnuje základní autokorelační a dekompoziční metodiku pro analýzu jednorozměrných časových řad. V teoretické oblasti se zaměřuje na metody exponenciálního vyrovnávání, v oblasti praktické pak na softwarové aplikace těchto metod pro finanční data.

Výklad sleduje klasické postupy z uvedené literatury. V práci jsem nenašel žádné systematické chyby (i když se zde objevují některé formální překlepy, chybějící čárky v souvětích, stylisticky neobratná vyjádření apod.). Reference [4] je neúplná. Grafická úroveň práce je dobrá. K práci mám některé drobné připomínky:

(1) 25₁₂: Odlišnost vzorce (3.11) ze softwaru NCSS a (3.8) z [3] je dána pouze odlišným značením a nikoli mechanismem daných vzorců.

(2) 31₂₋₁: Vyvozovat z uvedených MSE při daném měřítku řady, že jednoduché exponenciální vyrovnávání „vykazuje nejlepší shodu s pozorovanou řadou“ je trochu odvážné. Také co se týče předpovědních schopností jednotlivých metod, za kvalifikované srovnání bych považoval srovnání typu „out-of-sample prediction“, která porovnává předpovědi se skutečně pozorovanými hodnotami řady“.

(3) I když se práce zaměřuje na klasické „lineární“ přístupy k časovým řadám, vzhledem k aplikacím na finanční data by měl být aspoň letmo zmíněn problém volatility finančních časových řad, který uspokojivě řeší nelineární heteroskedastické modely typu GARCH.

(4) Který ze softwarových systémů používaných v práci by autor doporučil praktickému uživateli.

Závěr: Předloženou práci doporučuji uzнат jako práci bakalářskou.