

Posudek vedoucí na bakalářskou práci

Jakuba Filky

AUTOKORELAČNÍ A DEKOMPOZIČNÍ METODY
V ANALÝZE EKONOMICKÝCH ČASOVÝCH ŘAD

Data z oblasti ekonomie a financí mají velmi často podobu časových řad. Proto vyvstává potřeba umět je popsat a predikovat budoucí vývoj prostřednictvím vhodných matematických modelů. Přes množství specializovaných přístupů navržených v posledních letech zůstávají rozšířeným nástrojem klasické metody založené na stochastických ARMA procesech případně na deterministickém modelování trendu.

Autor se zaměřil na právě na tuto problematiku. Seznámil se s teoretickými základy a samostatně provedl odvození některých vzorců, zmínit lze zejména momentovou a korelační strukturu, momentové odhady parametrů a konstrukci předpovědí ve vybraných ARMA procesech. Provedl praktické ukázky s použitím dvou softwarových produktů (Mathematica, NCSS) na reálných datech, shrnul výhody a nevýhody a upozornil na odlišnosti v teoretickém popisu metod a jejich a softwarových implementacích, čímž splnil zadání práce.

Text je psán ve slovenském jazyce, doprovázejí jej obrázky a úseky výstupních protokolů z počítačového zpracování dat. Neobsahuje závažné věcné ani tiskové chyby. Matematickou, stylistickou i grafickou úroveň práce lze hodnotit jako průměrnou. Posлуhač pracoval na zvoleném tématu samostatně, iniciativně a se zájmem. Doporučuji proto přijmout předložený text jako bakalářskou práci.

V Praze 20.8.2014

RNDr. Jitka Zichová, Dr.