

Název práce: Vybrané problémy a metody při zpracování mnohorozměrných finančních dat

Autor: Lenka Goduřová

Katedra: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí bakalářské práce: RNDr. Jitka Zichová, Dr.

Abstrakt: Předložená bakalářská práce se zabývá zpracováním vícerozměrných dat. Úkolem bylo aplikovat vybrané metody na finanční data. Skládá se z teoretické části a zpracování konkrétní databáze. V prvních čtyřech kapitolách jsou shrnuté základní vztahy a pojmy týkající se náhodného vektora, náhodné veličiny, vícerozměrných dat a testu nezávislosti v kontingenční tabulce. Následující část je věnována popisu vybraných metod, kterými jsou shluková analýza a diskriminační analýza. V praktické části jsou tyto metody aplikované na databázi klientů německé banky.

Klíčová slova: náhodný vektor, mnohorozměrné rozdělení, mnohorozměrný náhodný výběr, kontingenční tabulka, shluková analýza, diskriminační analýza