

Oponentní posudek na diplomovou práci
Phillipsova křivka z pohledu analýzy časových řad v České republice a Německu

Autor: Bc. Ondřej král

Zvolené téma diplomové práce je zajímavé jak z hlediska statistického, tak i z hlediska ověření vzájemného vztahu inflace a nezaměstnanosti, který patří k základním ekonomickým vztahům využívaných jako nástroj hospodářské politiky státu. Práce má analytický charakter.

Autor analyzuje vztah mezi uvedenými makroekonomickými indikátory a snaží se potvrdit nebo vyvrátit hypotézu o existenci dlouhodobé závislosti mezi inflací a nezaměstnaností na základě analýzy čtvrtletních časových řad obou států za období let 1993 - 2016.

K analýze používá pokročilou statistickou teorii vícerozměrných časových řad včetně potřebného ověřování vlastností analyzovaných řad a vypočítaných modelů.

Zajímavost a užitečnost tématu a i úroveň celé diplomové práce snižuje celá řada nepřesností, nedůsledností a chyb.

Problém vidím např. v ověřování a posuzování sezónnosti analyzovaných řad. Autor v kap. 3.2.1 chybně interpretuje výsledky F-testu sezónnosti časových řad pro Německo (tab. 3.15 a 3.16), u českých časových řad není možno ověřit správnost závěrů, neboť tabulka, na kterou se autor odvolává, v textu chybí (str.22).

Chybná interpretace výsledku testování je např. i u JB testů normality nesystematické složky (tab. 3.10 a 3.26).

Autor správně uvádí, že hodnoty testového kritéria DW testu jsou v intervalu 0-4 a přitom ho nepřekvapuje vypočítaná hodnota testového kritéria vyšší než 200 (např. tab. 3.8).

V práci je řada překlepů v textu i ve vzorcích, na str. 31 vypadla nulová a alternativní hypotéza pro test regresního koeficientu atd. Celá práce působí dojmem, že ji autor po sobě nepřečetl.

V seznamu literatury jsou u některých titulů uvedeny různé roky.

Zajímavost práce i výsledků, k nimž autor dospěl, významně snižují uvedené nedostatky a chyby. Vzhledem k uvedeným chybám požaduji při obhajobě vysvětlit:

- jak je to s testováním sezónnosti a které výsledky jsou správné,
- použití a výsledky testů autokorelace a normality (DW test a JB test).

Závěr: hodnocení podmiňuji úspěšným obhájením práce s tím, že v případě uspokojivě vysvětlených nesrovnalostí v práci, doporučuji hodnocení „dobře“.

V Praze dne

doc. Ing. Dagmar Blatná, CSc.