

Posudek oponenta diplomové práce

Studijní program: **Kvantitativní metody v ekonomice**

Studijní obor: **Ekonometrie a operační výzkum**

Akademický rok: **2018/2019**

Název práce: **Analýza makroekonomické dynamiky pomocí VAR / TVAR modelů**

Řešitel: **Bc. Jan Pozler**

Vedoucí práce: **Ing. Tomáš Formánek, Ph.D.**

Oponent: **Ing. Jiří Georgiev**

	Hlediska	Stupeň hodnocení
1.	Jasnost a srozumitelnost formulace tématu a cíle práce	1
2.	Míra naplnění cíle	1
3.	Logická stavba práce a vzájemná konzistence jednotlivých částí	1
4.	Rozsah a relevance popisu současného stavu	1
5.	Adekvátnost metod k řešení problému, korektnost výběru a aplikace	1
6.	Rozsah, hloubka a preciznost popisu výsledku	1
7.	Relevance a správnost diskuze výsledku	1
8.	Korektnost a relevance informačních zdrojů	1
9.	Gramatika, jazykový styl, terminologie a celková úprava práce	1

Konkrétní připomínky a dotazy k práci:

Tato diplomová práce se zabývá modelováním vztahů mezi hrubým domácím produktem, inflací, mírou nezaměstnanosti a úrokovou mírou na datech za čtyři evropské země. K samotnému modelování byly použity VAR a TVAR modely. Diplomová práce je členěna přehledně a logicky. První část obsahuje podrobný popis použitých makroekonomických veličin a možných vztahů mezi nimi. Dále je v této části podrobně popsána teorie k použitým modelům časových řad.

V praktické části je vždy pro každou zemi odhadnuto několik modelů, ty jsou následně porovnány na základě predikčních schopností a na vybraném modelu jsou ověřeny předpoklady z teoretické části práce. Po formální stránce práce plně odpovídá úrovni diplomové práce. Dále velmi kladně hodnotím snahu o čitelný a hojně komentovaný skript, který je uveden v příloze práce a zaručuje tak snadnou replikovatelnost dosažených výsledků. Celkově práci doporučuji k obhajobě a hodnotím stupněm: Výborně.

Otázky:

1) Některé odhadnuté VAR modely nesplňují předpoklad homoskedasticity a jejich rezidua jsou korelována. Jakým způsobem byste se snažil tyto modely "zlepšit"?

Závěr: Diplomovou práci doporučuji k obhajobě.

Navrhovaná výsledná klasifikace práce: **1**

Datum: 3. 8. 2019

Ing. Jiří Georgiev
oponent práce