

JAK JÁ BYCH VYKLÁDAL METODU „BARONA PRÁŠILA“ ZNÁMOU V STATISTICKÉ LITERATUŘE JAKO BOOTSTRAP NOTES ON THE BOOTSTRAP METHOD

Josef Machek

Milé dámy a pánové¹, vážené čtenářky a vážení čtenáři našeho Bulletinu, dovoluji mi předem, abych převzal na svá bedra zodpovědnost za to, co je Vám zde předkládáno. Autor za nic nemůže, bohužel již s námi delší dobu není. A jak jsem jej znal, jistě by říkal, že to za plýtvání papírem nestojí. Ale já si myslím, že stojí. Dále se omlouvám za to, že nosím dříví do lesa. Dlouhé diskuse s profesorem Lvem Klebanovem, které jsme v poslední době vedli, mne ale přiměly opět přemýšlet o tak zvaných „resampling metodách“ všeho druhu. Při listování starými poznámkami na mne přitom vypadl útlý balíček dopisů, který jsem si založil do Efronovy knihy [4]. Když jsem si je opakovaně přečetl a připomněl si diskuse, které jsme s Josefem na toto téma vedli, přišlo mi, že by kus této korespondence mohl být zajímavý i pro některé z Vás.

Jistě se ptáte, jak a proč tyto dopisy vznikly. Bylo to takto: Začátkem devadesátých let přišla Marie Hušková s nápadem použít techniku bootstrap v oblasti detekce změn statistických modelů (*change-pointu*). Článek byl napsán, metodika byla vyzkoušena na datech reálných i simulovaných, a posléze i publikován, viz [2]².

Přes zajímavé výsledky jsem pojal vůči bootstrapu řadu podezření, s nimiž jsem otravoval nejenom spoluautory, ale také lidi z katedry. Jak už to bývá, každý má řadu svých úkolů a zájmů, asymptoticky to krásně fungovalo, dalo se o tom publikovat, takže se moje stížnosti moc „neuchytily“. Kupodivu jedním z mála, kdo si na diskuse se mnou našel nezvykle mnoho času, byl Josef Machek. Jeho první závěry po návratu z prázdnin, jež jako každoročně rozdělil mezi Kubu a Bílou Třemešnou, shrnuje začátek dopisu datovaném 11. září 1996.

¹Jak autor rád říkával. Dnes je to bohužel nemoderní, a soudě podle médií, se bojím, že se to pokusí zakázat i u nás, srovnejte [9], [10], [11] či [12].

²Přestože se náš článek neobjevil v žádném „hvězdném“ časopise, kam samozřejmě patřil, ale my jsme nepatřili ke správnému klanu, a nedostal se ani do WOSu, kde časopis sice je, ale náš článek nikoliv, čtenáři si jej všimli a patří mezi tři nejcitovanější (sobecky myslím, že zaslouženě) práce, které jsme díky Marii Huškové v oblasti *change-pointu* publikovali.