

Výpis ze zápisu z 6. zasedání Vědecké rady Matematicko-fyzikální fakulty  
v akad. roce 2018/2019 konaného dne 6. března 2019

## HABILITAČNÍ ŘÍZENÍ

**Návrh na jmenování RNDr. Jana Večeře, Ph.D., docentem pro obor *Matematika – pravděpodobnost a matematická statistika***

K habilitaci uchazeč předložil práci nazvanou *Integrated Exponentials of Brownian Motion and Related Processes with Applications to Asian Option Valuation*.

Habilitační komise pracovala ve složení – předseda: prof. Ing. Tomáš Tichý, Ph.D., (Vysoká škola báňská – Technická univerzita Ostrava), členové: prof. Ing. Miloslav Vošvrda, CSc., (Ústav teorie informace a automatizace Akademie věd ČR, v. v. i.), prof. RNDr. Jiří Witzany, Ph.D., (Fakulta financí a účetnictví Vysoké školy ekonomická v Praze), prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc., (Matematicko-fyzikální fakulta Univerzity Karlovy, Praha) a prof. RNDr. Viktor Beneš, DrSc., (Matematicko-fyzikální fakulta Univerzity Karlovy, Praha).

Tato komise jmenovala tři oponenty. Stali se jimi prof. Jan Hannig (The University of North Carolina at Chapel Hill, Department of Statistics and Operations Research, USA), prof. Aleš Černý (Cass Business School, City University London, Faculty of Finance, Velká Británie) a prof. Mark Brown (Columbia University, Department of Statistics, New York, USA).

Po zhodnocení výsledků vědecké a pedagogické práce uchazeče, jeho publikační činnosti a po obdržení kladných posudků na habilitační práci se komise tajným hlasováním jednomyslně usnesla na návrhu, aby RNDr. Jan Večeř, Ph.D., byl jmenován docentem. Všechny podklady - údaje o uchazeči, stanovisko habilitační komise, uchazečovo CV, přehled jeho pedagogické činnosti, výčet publikací, citací a zahraničních pobytů, aktuální výpis z WoS i posudky oponentů - dostala vědecká rada předem k dispozici, habilitační práce na zasedání kolovala.

Habilitační přednáška nesla též název jako předložená práce, tedy *Integrated Exponentials of Brownian Motion and Related Processes with Applications to Asian Option Valuation*.

Uchazeč ji přednesl anglicky, podle přehledného schématu a doprovázenou vždy citacemi reprezentativních článků (některé vybrané názvy částí prezentace: *History of the Proposed Approaches; Monte Carlo Simulation, Approximations + Bounds; Semianalytical Solutions, Partial Differential Equations; General Concept of Price; Arbitrage; First Fundamental Theorem of Asset Pricing; Definition of the Average Asset; Average Asset; Relationship to Asian options; Examples + Black-Scholes; Geometric Brownian Motion; Graphs; Laplace Transform III, IV, V, ...*).

Prod. J. Trlifaj na počátku veřejné rozpravy připomněl posudky, které na práci obdržela habilitační komise, a citoval z nich podstatné pasáže. Všichni tři oponenti bez rozdílu práci chválili.

Prof. Jan Hannig: *The habilitation consist of an extremely well written introduction and 6 mostly single author papers. The introduction presents an engaging primer on option pricing theory including the main mathematical tools needed. Then, a very readable account of results for Asian options extends his seminal works on this topic. Prof. Večeř proves himself to be a clear and careful writer. I would not expect anything else after reading his well-received book.*

Prof. Aleš Černý: *In 'The Ancestor's Tale', Richard Dawkins mentions the popular myth of 'the larval sea squirt which, when the time comes, settles down to a sedentary life and 'eats its brain like an associate professor getting tenure'.' Jan's journey home via U.S., Japan, and*

*Germany has been long, rewarding, and full of sacrifice. Without wishing to prejudge the panel's decision, I believe that this appointment will not so much be an end of a journey as a start of the next important chapter and that Jan, as one of the most original thinkers of his generation, will continue to surprise us with novel insights for many years to come.*

Prof. Mark Brown: *The author's work is recognized internationally. Moreover, he continues to produce new quality papers, which is a promising sign for achieving further prominence in this research area. In conclusion, the author has made important contributions to the asset pricing theory and I recommend the award of the habilitation for this work.*

Diskuse měla živý charakter a dávala znát, že téma i vhléd uchazeče jsou pro auditorium velice zajímavé. Poté, kdy uchazeč odpověděl na otázky prof. J. Hořejšího, prof. A. Kučery, prof. B. Maslowského, prof. P. Jungwirtha, prof. L. Skrbka, prof. J. Matase a prof. J. Trlifaje, byl vyzván ke shrnutí práce komise její předseda prof. T. Tichý. Hovořil krátce, protože podrobnou zprávu vědecká rada dostala předem. Komise uzavřela své stanovisko takto: „Z habilitačního spisu, jeho příloh a dalších veřejně dostupných informací jednoznačně vyplývá, že Dr. Večeř je vyzrálou vědeckou osobností a úspěšným pedagogem s širokým mezinárodním přesahem a celou řadou kontaktů na prestižních univerzitách. Jeho práce jsou obvykle publikovány v prestižních mezinárodních časopisech a nakladatelstvích a jsou ceněny mezinárodní vědeckou komunitou v dané oblasti, o čemž svědčí i jejich dobrý citační ohlas. Jeho publikace jsou jak samostatným autorským počinem, tak výsledkem širší spolupráce s (bývalými) studenty i dalšími osobnostmi činnými v dané oblasti. Vychoval mnoho talentovaných studentů, kteří se již velmi dobře etablovali v praxi i v akademickém prostředí (plný profesor), působí na University of California in Berkeley, City University of New York a New Jersey Institute of Technology a vychovávají své vlastní studenty. Jeho výsledky jak ve vědecké, tak v pedagogické činnosti jednoznačně splňují kritéria pro habilitační řízení na MFF UK a komise, s přihlédnutím k vysoce pozitivnímu hodnocení všemi oponenty, proto doporučuje udělit J. Večeřovi vědecko-pedagogickou hodnost docent v oboru Pravděpodobnost a matematická statistika.“

Následovala neveřejná část zasedání, v jejímž závěru vědecká rada o návrhu hlasovala. Skrutátory pro tajné hlasování byli prof. J. Hajič a prof. P. Tvrdlík.

| Stav hlasování                    |    |
|-----------------------------------|----|
| Počet členů VR fakulty celkem     | 26 |
| Počet přítomných členů VR fakulty | 22 |
| Počet kladných hlasů              | 21 |
| Počet záporných hlasů             | 0  |
| Zdrželo se                        | 0  |
| Počet neplatných hlasů            | 1  |

Vědecká rada se tak usnesla na návrhu, aby RNDr. Jan Večeř, Ph.D., byl jmenován docentem pro obor *Matematika – pravděpodobnost a matematická statistika*. Návrh bude postoupen rektorovi Univerzity Karlovy.

Za správnost:

T. Pávková