

Univerzita Karlova

Fakulta sociálních věd

Zápis o obhajobě disertační práce

Akademický rok: 2018/2019

Jméno a příjmení studenta: František Čech
Identifikační číslo studenta: 63757646
Typ studijního programu: doktorský
Datum narození:
Studijní program: Ekonomické teorie
Studijní obor: Ekonomie
Forma studia: prezenční kombinovaná distanční
Standardní doba studia: čtyřletá
Identifikační číslo studia: 422132
Datum zápisu do studia: 23. 9. 2013

Název práce: Three Essays on Risk Modelling and Empirical Asset Pricing
Jazyk práce: anglický jazyk
Jazyk obhajoby:
Obor práce: Ekonomie
Školitel: doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.
Konzultant:
Oponenti: Michael Ellington BA, MSc, Ph.D.
Fredj Jawadi, Ph.D.
prof. Ing. Evžen Kočenda M.A., Ph.D. DSc.

Datum obhajoby: 4. 6. 2019 **Místo zkoušky¹:** IES, Opletalova 26, Praha 1
Termín: řádný opravný **místnost 109**

Průběh zkoušky:

PŘEDSEDA KOMISE UVÍTAL PŘÍTOMNÉ, PŘEDSTAVIL ŠKOLITELE, Oponenty a ostatní členy komise. Následně František Čech stručně shrnul všechny části své disertační práce a detailně prezentoval druhou kapitolu své práce s názvem: "MEASUREMENT OF COMMON RISK FACTORS IN TAILS: A PANEL QUANTILE REGRESSION MODEL FOR RETURNS." Po prezentaci školitel shrnul spolupráci s kantiškou občany, přítomní oponenti shrnul své posudek na práci a posudek napřítočných ~~oponentů~~ oponentů shrnul ostatní členové komise. Na závěr proběhla diskuse s kantiškou a přítomnou veřejností. Poté veřejnost opustila sál a ověřila ověřit obhajoby.

¹ Město

Otázka: What is your contribution compared to the papers of your supervisor?

Odpověď: In this paper we analyze the tails and as first use the panel quantile regression with large time dimension of data.

Hodnocení komise: KOMISE BYLA SPOKOJENA S ODPOVĚDÍ!

Otázka: In bounds you use the same analysis?

Odpověď: No, there we apply a standard panel analysis and the results are not much different.

Hodnocení komise: KOMISE BYLA SPOKOJENA S ODPOVĚDÍ!

Otázka: What is the difference between the Univariate and Quantile regression?

Odpověď: We simulated 2 different distributions (the Univariate the of diagonal elements are zero, so the simulated series are more closer to each other. And Univariate Quantile regression is not better always.

Hodnocení komise: KOMISE BYLA SPOKOJENA S ODPOVĚDÍ!

Otázka: So if you put lambda to zero it means that there is high heterogeneity?

Odpověď: YES

Hodnocení komise: KOMISE BYLA SPOKOJENA S ODPOVĚDÍ!

Hlasování komise: počet hlasů "prospěl/a" 5 počet hlasů "neprospěl/a" 0

Výsledek zkoušky: prospěl/a neprospěl/a

Předseda komise²: doc. PhDr. Petr Teplý, Ph.D.

Členové komise²:

Michael Ellington, BA, MSc, Ph.D.

Fredj Jawadi, Ph.D. ..

Prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc

Mgr. Lukáš Vácha, Ph.D.

doc. PhDr. Martin Gregor, Ph.D. .

doc. PhDr. Ladislav Křišťoufek, Ph.D.

Podpis studenta:

² Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK počet přítomných členů zkušební komise nesmí být menší než tři.

³ Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK podepisuje předseda a nejméně jeden další člen komise. Dle čl. 11 odst. 9 SZŘ UK za činnost zkušební komise odpovídá předseda komise, v mimořádném případě může předsedu zastoupit ve všech jeho pravomocech člen, na němž se zkušební komise usnese.

PROTOKOL O HLASOVÁNÍ

Jméno a příjmení studenta: František Čech

Identifikační číslo studenta: 63757646

Počet přítomných členů komise²:

Předseda komise: doc. PhDr. Petr Teplý, Ph.D.

Členové komise²: Michael Ellington, BA, MSc, Ph.D.

Fredj Jawadi, Ph.D.

Prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

Mgr. Lukáš Vácha, Ph.D.

doc. PhDr. Martin Gregor, Ph.D.

doc. PhDr. Ladislav Křišťoufek, Ph.D.

Počet hlasů: prospěl/a neprospěl/a

Klasifikace: Prospěl/a Neprospěl/a

Podpis předsedy komise³:

Podpis člena/ů komise³:

² Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK počet přítomných členů zkušební komise nesmí být menší než tři.

³ Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK podepisuje předseda a nejméně jeden další člen komise. Dle čl. 11 odst. 9 SZŘ UK za činnost zkušební komise odpovídá předseda komise, v mimořádném případě může předsedu zastoupit ve všech jeho pravomocech člen, na němž se zkušební komise usnese.

PROTOKOL O TAJNÉM HLASOVÁNÍ

Jméno a příjmení studenta: František Čech

Datum narození:

Identifikační číslo studenta: 63757646

Počet přítomných členů komise²:

Počet hlasů: prospěl/a neprospěl/a

Výsledek hlasování: prospěl/a neprospěl/a

Podpis předsedy komise³:

Podpis člena/ů komise³:

² Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK počet přítomných členů zkušební komise nesmí být menší než tři.

³ Dle čl. 11 odst. 13 SZŘ UK podepisuje předseda a nejméně jeden další člen komise. Dle čl. 11 odst. 9 SZŘ UK za činnost zkušební komise odpovídá předseda komise, v mimořádném případě může předsedu zastoupit ve všech jeho pravomocech člen, na němž se zkušební komise usnese.