



MATEMATICKO-FYZIKÁLNÍ
FAKULTA
Univerzita Karlova

Zápis o obhajobě disertační práce

Akademický rok: 2021/2022

Jméno a příjmení studenta: Mgr. Robert Navrátil
Identifikační číslo studenta: 16054517

Typ studijního programu: doktorský
Studijní program: Pravděpodobnost a statistika, ekonometrie a finanční matematika

Studijní obor: Pravděpodobnost a statistika, ekonometrie a finanční matematika

ID studia: 559248

Název práce: On Market Efficiency, Optimal Distributional Trading Gain, and Utility Maximization
Pracoviště práce: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky (305. • 32-KPMS)

Jazyk práce: angličtina
Jazyk obhajoby: čeština
Školitel: doc. RNDr. Jan Večeř, Ph.D.
Oponent(i): prof. RNDr. Jiří Witzany, Ph.D.
Jan Pospíšil

Datum obhajoby: 07.06.2022 **Místo obhajoby:** Praha
Termín: řádný

Průběh obhajoby: Předseda komise pro obhajobu B. Maslowski přivítal všechny přítomné a konstatoval, že je přítomno všech 7 členů komise pro obhajobu, oba oponenti, školitel i uchazeč. Dále konstatoval, že jsou prokazatelně splněny podmínky pro konání obhajoby: Uchazeč složil všechny dílčí zkoušky a další povinnosti podle individuálního studijního plánu, je k dispozici doklad o vykonání státní doktorské zkoušky a zkoušky z angličtiny. Uchazeč předložil disertační práci ve formě předepsané OR, stručný životopis, seznam publikací a autoreferát. Školitel poskytl vyjádření k průběhu studia uchazeče a jeho disertační práci. Komise byla poté seznámena s životopisem a seznamem publikací, bylo konstatováno, že uchazeč má tři publikované práce a jeden rukopis připravovaný k publikaci. Poté se školitel vyjádřil k uchazeči a jeho disertaci, konstatoval, že uchazeč řádně splnil všechny zkoušky a požadavky studijního plánu a v disertační práci dosáhl výborných výsledků. Dále uchazeč v půlhodinové prezentaci vyložil stručný obsah své disertace. Následovala vystoupení oponentů ing. Pospíšila a prof. Witzanyho. Oba doporučili disertační práci k obhajobě. Oponenti ve svých vystoupeních formulovali několik otázek a (převážně formálních) námitek, např. ohledně positivity odhadované hustoty

g(k) a vlivu transakčních nákladů na prezentované postupy. Uchazeč zodpověděl všechny otázky oponentů a ti vyjádřili s jeho odpovědí spokojenost.

Následovala všeobecná rozprava. V ní vznesl dr. Swart dotaz ke tvaru věrohodnostního poměru používanému v práci, prof. Cipra se tázal, zda lze provést reziduální analýzu v případě části práce zabývajícími se covidovými daty. Doc. Branda požádal o srovnání používaného (spojitého) modelu s diskretním a dr. Šmíd o vyjasnění vztahu mezi třemi v práci používanými pravděpodobnostmi (pravděpodobnostními mírami). Uchazeč na všechny dotazy uspokojivým způsobem reagoval. Tím bylo zakončena veřejná část obhajoby.

Výsledek obhajoby:	prospěl/a (P)	
Předseda komise:	prof. RNDr. Bohdan Maslowski, DrSc.
Členové komise:	prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc.
	doc. RNDr. Martin Branda, Ph.D.
	doc. RNDr. Ing. Miloš Kopa, Ph.D.
	Dr. Jan Swart
	RNDr. Martin Šmíd, Ph.D.
	prof. RNDr. Jiří Witzany, Ph.D.