MATEMATICKO-FYZIKÁLNÍ
FAKULTA
Univerzita Karlova

Zápis o obhajobě disertační práce

Akademický rok: 2021/2022

Jméno a příjmení studenta:	RNDr. Tomáš Rusý
Identifikační číslo studenta:	10378354
Typ studijního programu:	doktorský
Studijní program:	Pravděpodobnost a statistika, ekonometrie a finanční matematika
Studijní obor:	Pravděpodobnost a statistika, ekonometrie a finanční matematika
ID studia:	559250
Název práce:	Asset-Liability Management: Application of Stochastic Programming with Endogenous Randomness and Contamination
Pracoviště práce:	Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky (305. • 32-KPMS)
Jazyk práce:	angličtina
Jazyk obhajoby:	čeština
Školitel:	doc. RNDr. Ing. Miloš Kopa, Ph.D.
Oponent(i):	Giorgio Consigli doc. RNDr. Martin Branda, Ph.D.
Datum obhajoby:	14.12.2021 **Místo obhajoby:** Praha
Termín:	řádný
Průběh obhajoby:	Po úvodním slovu, vedoucí práce seznámil komisi se svým posudkem. Pak RNDr. Tomáš Rusý představil hlavní výsledky své práce. Věnoval se zejména modelu rozhodování bankovního subjektu a rozhodování zákazníka. Pro vzniklou úlohu stochastického programování uchazeč odvodil nové horní a dolní odhady optimální hodnoty. Pro zpracování empirických dat byly využity cénářové stromy. Po přednášce oba oponenti přečetli své kritické posudky. Vyzdvihli aktuálnost tématu práce a kladně hodnotili pečlivé zpracování. Student zodpověděl dotazy z oponentských posudků. Pak následovala veřejná rozprava, kde student opět věcně a s přehledem odpovídal na položené dotazy. Následovala krátká porada komise při které se komise sjednotila na jednoznačném pozitivním hodnocení.

Výsledek obhajoby:	prospěl/a (P)	
Předseda komise:	doc. RNDr. Petr Lachout, CSc.	.....
Členové komise:	doc. RNDr. Martin Branda, Ph.D.	.....
	prof. RNDr. Ing. Michal Černý, Ph.D.	.....
	doc. RNDr. Zdeněk Hlávka, Ph.D.	.....
	doc. RNDr. Zuzana Prášková, CSc.	.....
	RNDr. Martin Šmíd, Ph.D.	.....
	prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc.	.....