

Univerzita Karlova v Praze
Matematicko-fyzikální fakulta

ZÁZNAM O PRŮBĚHU OBHAJOBY
DISERTAČNÍ PRÁCE

Název práce: Modelování úrokových sazeb na finančních trzích

Jazyk práce: český

Jméno studenta: RNDr. Petr Myška

Studijní program: matematika

Studijní obor: 4m-7 Finanční a pojistná matematika

Školitel: doc. RNDr. Jan Hurt, CSc. (přítomen)

Oponenti: Ing. Jan Vejmělek, Ph.D., CFA (komerční banka Praha) (nepřítomen)
RNDr. Stanislav Kepřta, Ph.D. (Raiffeisenbank, a.s.) (přítomen)

Členové komise: prof. RNDr. T. Cipra, DrSc. (přítomen)
RNDr. L. Mazurová, Ph.D. (přítomen)
RNDr. T. Herbst, CSc. (přítomen)
RNDr. Stanislav Kepřta, Ph.D. (přítomen)
RNDr. M. Laušmanová, CSc. (přítomen)
prof. RNDr. J. Štěpán, DrSc. (přítomen)
RNDr. D. Vorlíčková, CSc. (přítomen)

Datum obhajoby: 19. dubna 2012

Průběh obhajoby:

Obhajobu zahájil prof. Cipra. Uchazeč byl představen prof. Ciprou. Uchazeč splnil všechny dílčí zkoušky, předložil doklady o vykonání státní doktorské zkoušky a doklad o zkoušce z angličtiny. Dále uchazeč předložil disertační práci ve formě předepsané OR, stručný životopis a seznam publikovaných prací.

Ze sedmičlenné komise jmenované pro obhajobu je přítomno všech 7 členů. Zákonné podmínky pro konání obhajoby jsou tímto splněny. Žádné připomínky k vystavené práci nedošly.

Prof. Cipra seznámil komisi s životopisem uchazeče, přehledem vědeckých prací a jejich posudky. Seznam publikací společně s disertační prací dal prof. Cipra kolovat komisi.

Prof. Cipra vyzval školitele uchazeče, doc. Hurta, ke stručnému vyjádření k disertační práci. Doc. Hurt konstatoval, že disertační práce splňuje všechny požadavky pro její uznání.

Prof. Cipra poté předal slovo dr. Myškovi, aby vyložil podstatný obsah své disertační práce.

Pokyny pro předsedy nebo místopředsedy komisi:

Práce v elektronické podobě musí být studentem vložena do SIS. Formulář vyplňte ve všech bodech v elektronické podobě. V bodě Členové komise se uvedou všichni členové komise a za jejich jména se uvede „(přítomen)“ nebo „(nepřítomen)“. Předseda nebo místopředseda komise je jejím členem. V bodě Průběh obhajoby by měly být uvedeny alespoň čtyři věty vystihující průběh obhajoby. Po vyplnění formuláře ho vytiskněte, dole formulář ještě vlastnoručně podepište a přiložte k zápisu o státní závěrečné zkoušce. Současně vložte formulář v elektronické podobě (bez vlastnoručního podpisu) do SIS.

Prof. Cipra představil oponenty: dr. Keprtu, dr. Vejmělka. Dr. Vejmělek se omluvil z důvodu dlouhodobé zahraniční cesty, jeho posudek přednesl prof. Cipra. Dr. Keprta přednesl svůj posudek. Shrnul obsah disertační práce. Dr. Keprta doporučuje práci k obhajobě. Dr. Vejmělek ve svém posudku vyzdvihnul matematicko-statistickou erudici disertační práce. Dr. Vejmělek doporučuje doktorskou disertační práci k obhajobě. Uchazeč uspokojivě zodpověděl vznesené dotazy oponentů.

Prof. Cipra zahájil všeobecnou rozpravu. Dr. Herbst vznesl připomínku ohledně výpočtu středních hodnot vzhledem k rizikově neutrální a reálné pravděpodobnostní míře. Dále vznesl dotaz ohledně simulací VaR při rizikově neutrální míře. Uchazeč uspokojivě zodpověděl jeho dotazy. Dr. Laušmanová vznesla dotaz ohledně výsledků simulovaných portfolií. Uchazeč uspokojivě odpověděl. Prof. Cipra vznesl dotaz ohledně praktického využívání prezentovaných metod. Prof. Cipra vznesl druhý dotaz ohledně použitých statistických testů. Uchazeč uspokojivě dotaz zodpověděl.

Prof. Cipra uzavřel všeobecnou rozpravu. Prof. Cipra hodnotí průběh obhajoby kladně.

Na základě rozhodnutí RDSO je uchazečovi udělen titul PhD.

Prof. Cipra ukončil obhajobu disertační práce.

Počet publikací: 5

Výsledek hlasování:

Počet členů s právem hlasovacím: 7

Počet přítomných členů: 7

Odevzdáno hlasů kladných: 7

Odevzdáno hlasů neplatných: 0

Odevzdáno hlasů záporných: 0

Výsledek obhajoby: prospěl/a neprospěl/a

Předseda nebo místopředseda komise:

Prof. RNDr. T. Cipra, DrSc.

Pokyny pro předsedy nebo místopředsedy komisi:

Práce v elektronické podobě musí být studentem vložena do SIS. Formulář vyplňte ve všech bodech v elektronické podobě. V bodě Členové komise se uvedou všichni členové komise a za jejich jména se uvede „(přítomen)“ nebo „(nepřítomen)“. Předseda nebo místopředseda komise je jejím členem. V bodě Průběh obhajoby by měly být uvedeny alespoň čtyři věty vystihující průběh obhajoby. Po vyplnění formuláře ho vytiskněte, dole formulář ještě vlastnoručně podepište a přiložte k zápisu o státní závěrečné zkoušce. Současně vložte formulář v elektronické podobě (bez vlastnoručního podpisu) do SIS.