

Vyjádření vedoucího k disertační práci Mgr. Andrey Karlové

Options under Stable Laws

Na počátku musím říci, že cesta A. Karlové k disertaci vůbec nebyla jednoduchá, a to částečně i z objektivních důvodů. Andrea vystudovala obor Pravděpodobnost, matematická statistika a ekonometrie a diplomovou práci napsala na téma Statistické metody založené na L1 normě, tedy z oblasti matematické statistiky. V tomto směru se snažila pokračovat i v počátku doktorského studia, kdy jsem se stal jejím vedoucím. Pak ovšem radikálně změnila téma a začala se zabývat problémy stochastické analýzy a dopady do metod finanční matematiky. Na jedné straně se ukázalo, že toto téma ji zaujalo a skutečně se mu naplno a do hloubky věnovala. Na druhé straně to mělo několik důsledků. Především, tato oblast byla pro Andreu poměrně nová a hodně času a energie jí zabralo vůbec se zde orientovat a nastudovat základy i relevantní současné výsledky. Zároveň, musím přiznat, v této oblasti jsem jí už jako vedoucí nemohl příliš pomoci a byla odkázána na konzultace. Zde bych rád poděkoval především prof. J. Štěpánovi za jeho trpělivost, s jakou se Andree věnoval. Dále, při tomto "prohledávání" témat nebylo dlouho jasné, co vlastně bude obsahem budoucí disertace. Andrea stačila vystoupit s dílčími problémy na mnoha seminářích, na KPMS i jinde, ale typicky po referátu a sepsaných tezích, výzkumné zprávě či konferenčním příspěvku nenásledovalo další úsilí k dotažení do "seriózní" publikace, místo toho se zpravidla začla věnovat některému souvisejícímu tématu. To je jistě chvályhodné, a musím říci, že vždy po konzultaci s Andreou jsem byl zasažen jejím nadšením pro právě studovanou otázku. Ale právě tento přístup měl za následek, že dlouho její práce vypadala jako souhrn nedořešených fragmentů. Teprve v poslední době z nich vykryštovala konkrétní náplň disertace, včetně originálních příspěvků autorky, a tedy také dostatek materiálu pro články v impaktovaných odborných časopisech. Takže nyní jsou dva v recenzním řízení (k dnešnímu dni neznám výsledek).

Nakonec tedy Andrea našla svoje téma a sepsala disertaci, která, jak soudím, obsahuje přínos jak v oblasti teorie stabilních rozdělení, tak v oblasti jejich využití v modelech finanční matematiky. Proto také soudím, že Andrea Karlová prokázala své schopnosti k vědecké práci, považuji práci za odpovídající požadavkům na práci disertační a doporučuji ji přijmout k obhajobě.

Praha, 25.9.2013

Petr Volf

ÚTIA AV ČR