

**UNIVERZITA KARLOVA**

Fakulta sociálních věd

**Zápis o části státní závěrečné zkoušky  
Záznam o průběhu obhajoby**

Akademický rok: 2017/2018

**Jméno a příjmení studenta:** Bc. Lenka Röhryová  
**Datum narození:** 15.12.1991  
**Identifikační číslo studenta:** 91485353

**Typ studijního programu:** navazující magisterský  
**Studijní program:** Ekonomické teorie  
**Studijní obor:** Ekonomie a finance  
**Identifikační číslo studia:** 517747

**Název práce:** Extending volatility models with market sentiment indicators  
**Pracoviště práce:** Institut ekonomických studií  
**Jazyk práce:** angličtina  
**Jazyk obhajoby:** čeština  
**Vedoucí:** doc. PhDr. Ladislav Křišťoufek, Ph.D.  
**Oponent(i):** doc. PhDr. Ing. Petr Jakubík, Ph.D.

**Datum obhajoby :** 31.01.2018      **Místo obhajoby :** Praha

**Průběh obhajoby:** The student presented her master thesis research focusing first on the motivation for volatility modeling, 3 working hypotheses, dataset specification and the Naive Bayes machine learning method. Lexicon based methods and standard GARCH methodology were introduced before the conclusion of results. The student stressed contribution of the works at the end of her presentation. The committee then discussed topics of the difference between TGARCH and HAR, behavioral aspects contained in HAR, the time span of the dataset, and the issue of repetitions of the information online. The student was able to react to all these questions very well. The final decision of the committee based on the student's performance during the defense is B.

**Výsledek obhajoby:** výborně

**Předseda komise:** prof. Ing. Michal Mejstřík, CSc. (přítomen) .....

**Členové komise:** Ing. Vilém Semerák, M.A., Ph.D. (přítomen) .....  
Mgr. Bc. Magda Pečená, Ph.D. (přítomen) .....  
PhDr. Mgr. Jiří Kukačka, Ph.D. (přítomen) .....