

UNIVERZITA KARLOVA

Fakulta sociálních věd

Zápis o části státní závěrečné zkoušky Záznam o průběhu obhajoby

Akademický rok: 2018/2019

Jméno a příjmení studenta: Bc. Ira Saktor
Datum narození: 31.05.1994

Typ studijního programu: navazující magisterský
Studijní program: Ekonomické teorie
Studijní obor: Ekonomie a finance

Zadavatel práce: Institut ekonomických studií (23-IES)
Název práce: Are realized moments useful for stock market returns analysis?

Jazyk práce: angličtina
Jazyk obhajoby: čeština
Vedoucí: doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.
Oponent(i): prof. Ing. Evžen Kočenda, Ph.D.

Datum obhajoby : 19.06.2019 **Místo obhajoby :** Praha

Průběh obhajoby: The initial presentation introduced the development of asset pricing models and then focused on the type of models (realized moments) used by the author and the results of his analysis. Then he answered questions focused on the (i) logic of the use of realized moments, especially of skewness and kurtosis, and the relationship of the variables to risk premia and to the logic of efficient market hypothesis, (ii) the role of variance in the specification (and of possibly higher powers of variance), (iii) empirical usability of the identified pricing patterns. The student clearly demonstrated a significant degree of enthusiasm and understanding of the methodology.

Výsledek obhajoby: výborně (A)

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

Členové komise: prof. Ing. Evžen Kočenda, Ph.D. (přítomen)
doc. PhDr. Ladislav Křišťoufek, Ph.D. (přítomen)
Ing. Vilém Semerák, M.A., Ph.D. (přítomen)