

Zápis z obhajoby doktorské disertační práce
RNDr. Ing. Miloš Kopa: „Utility Functions in Portfolio Optimization“

Obhajoba se konala před komisí **m-5 Ekonometrie a operační výzkum** dne 11. září 2006 v 13:00 na MFF UK, Ke Karlovu 3, Praha 1, místnost 105.

Předseda komise: Doc. Ing. J. Outrata, DrSc. (ÚTIA AV ČR)
Členové komise: Prof. RNDr. V. Dupač, DrSc. (MFF UK)
RNDr. V. Kaňková, CSc. (ÚTIA AV ČR)
Doc. RNDr. P. Lachout, CSc. (MFF UK)
Prof. RNDr. K. Zimmermann, DrSc. (MFF UK)
Doc. Ing. M. Vošvrda, CSc. (ÚTIA AV ČR)
Prof. RNDr. M. Mañas, DrSc. (VŠE)
RNDr. D. Glückaufová, CSc. (CMC)
Doc. RNDr. Z. Prášková, CSc. (MFF UK)
Oponenti: Prof. RNDr. K. Zimmermann, DrSc. (MFF UK)
Prof. Dr. T. Post, Ph.D. (Erasmus University, Rotterdam)
Hosté: Prof. RNDr. J. Dupačová, DrSc. (MFF UK)
Barbora Hirnerová
RNDr. Pavel Vaněček – zapisovatel

Předseda komise Doc. Outrata představil doktoranda RNDr. Kopu a seznámil přítomné s jeho životopisem a seznamem publikací - seznam včetně samotných publikací měla komise k dispozici. Dále předseda zmínil četná doktorandova ocenění z vědeckých soutěží a jeho zahraniční studijní pobyty, především stáž v Rotterdamu. Školitelka Prof. Dupačová informovala o průběhu studia doktoranda, připomněla jeho aktivní podíl na výuce, výzkumu a plnění grantu a vyzdvihla doktorandovo paralelní studium na VŠE. Poté uchazeč prezentoval svoji disertační práci zabývající se optimalizací portfolia z pohledu užitkové funkce. Podrobně seznámil přítomné s jejím obsahem, definoval rizikové prémie, zaměřil se na modely s více periodami, uvedl vlastní test FSD optimality a diskutoval jeho použitelnost v praxi. Následně oponent Prof. Zimmermann seznámil přítomné se svým oponentským posudkem, ve kterém ocenil aktuálnost práce, její praktickou použitelnost a který neměl k práci podstatných připomínek. Do diskuze položil otázku o motivaci pro hledání konvexnosti v teorii užitkových funkcí. Předloženou práci doporučil přijmout k obhajobě. Posudek oponenta Prof. Posta přečetl předseda komise. Posudek byl doporučujícího charakteru bez dalších připomínek. Prof. Dupačová požádala uchazeče, aby v kapitole 5 své práce rozlišil, co je jeho vlastním výsledkem a co je společná práce s Prof. Postem. RNDr. Kopa tak učinil a potvrdil, že finanční aplikace Prof. Posta není v práci uvedena. Předseda komise otevřel diskuzi. Doc. Vošvrda ocenil kvalitu uchazečových soutěžních prací a měl několik technických dotazů, které uchazeč uspokojivě zodpověděl. Prof. Dupačová zdůraznila kvalitu uchazeče a možnost na jeho práci navázat, byť tato je úplná ve svém směru. Doc. Outrata se otázal na aproximace užitkových funkcí, na konvergenci optimálního řešení a na odhad velikosti chyby aproximace. Všechny dotazy uchazeč zodpověděl.

V neveřejné části obhajoby proběhlo tajné hlasování s tímto výsledkem:

Počet členů s hlasovacím právem:	9
Počet přítomných členů s hlasovacím právem:	6
Odevzdáno kladných hlasů:	6
Odevzdáno záporných hlasů:	0
Odevzdáno neplatných hlasů:	0

Závěrečné stanovení komise:

Bylo shledáno, že práce splňuje požadavky kladené touto fakultou na doktorskou disertační práci a proto komise uděluje RNDr. Ing. Miloši Kopovi titul Ph.D. v oboru Ekonometrie a operační výzkum.

V Praze dne 11. září 2006
Zapsal: P. Vaněček