

UNIVERZITA KARLOVA

Fakulta sociálních věd

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

Akademický rok: 2017/2018

Jméno a příjmení studenta: Bc. Ksenia Pogodina
Datum narození: 11.05.1994
Identifikační číslo studenta: 26067484

Typ studijního programu: navazující magisterský
Studijní program: Ekonomické teorie
Studijní obor: Ekonomie a finance
Specializace: Finance, finanční trhy a bankovníctví
Identifikační číslo studia: 482933

Název práce: News Feed Classifications to Improve Volatility Predictions
Pracoviště práce: Institut ekonomických studií
Jazyk práce: angličtina
Jazyk obhajoby: čeština
Vedoucí: PhDr. Boril Šopov, M.Sc., LL.M.
Oponent(i): RNDr. Michal Červinka, Ph.D.

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

Průběh obhajoby: The student presented his 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 student finally answered 3 main suggested questions from the opponent's report. The committee then discussed topics of the ADF and the KPSS specification, the difference between the AIC and BIC, structure of the dataset, creation, and reliability of the sentiment variable. 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)