

UNIVERZITA KARLOVA

FAKULTA SOCIÁLNÍCH VĚD

individuální studijní plán
studenta doktorského studijního programu

ID plánu 12609

Student

Příjmení, jméno (titul)
E-mail
Fakulta
Studijní program
Studijní obor
Standardní délka studia (počet let)
Forma studia
Datum zahájení doktorského studia

Mgr. Matěj Nevrla
Falco707@seznam.cz
Fakulta sociálních věd
Ekonomické teorie (P6201)
Ekonomie (6201V004)
4
prezenční
01.09.2016

Předseda oborové rady

Příjmení, jméno (titul)

prof. RNDr. Jan Ámos Víšek, CSc.

Školitel

Příjmení, jméno (titul)
E-mail
Katedra / ústav

PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.
barunik@fsv.cuni.cz
Institút ekonomických studií (23-IES)

Konzultant

Příjmení, jméno (titul)
E-mail
Katedra / ústav

Disertační práce

Název práce
Three essays on quantile cross-spectral measures of dependence
Postup v přípravě disertační práce
Práce se bude zabývat novými přístupy ke klasickým ale stále velice aktuálním ekonomickým a ekonometrickým problémům jako oceňování finančních aktiv (CAPM), kauzalitou v časových řadách (Grangerova kauzalita) a dalšími. Jak ukazuje současná literatura, ekonomičtí agenti při svém rozhodování berou v potaz rozměr horizontu trvání ekonomického šoku (např. Bandi & Tamoni (2015)) a také rozměr asymetrie pravděpodobnostního rozložení ekonomických šoků (Ghysels a další (2016)). To vede pak k tomu, že se rozdílně rozhodují, pokud optimalizují svůj užitek v krátkém, středním a dlouhém období a zároveň jinak v příznivém a nepříznivém období. Nový pohled na tato témata bude vycházet z teoretického rámce obsaženého v práci Baruník & Kley (2015). Nové míry závislosti mezi ekonomickými proměnnými definované v kontextu frekvencí a kvantilů společného rozdělení nám umožňují zkoumat závislosti, které dříve nebylo možné odhalit, a v návaznosti na to definovat nové modely, které tyto vlastnosti budou zachycovat.
Základní literatura: Baruník, J., & Kley, T. (2015). Quantile Cross-Spectral Measures of Dependence between Economic Variables. Available at SSRN 2678977. Bandi, F. M., & Tamoni, A. (2015). Business-cycle consumption risk and asset prices. Available at SSRN 2337973. Ghysels, E., Plazzi, A., & Valkanov, R. (2016). Why invest in emerging markets? The role of conditional return asymmetry. The Journal of Finance.
Forma a rozsah práce: Práce bude mít formu 3 článků v celkovém rozsahu 100-200 stran.
Časový plán zpracování disertační práce: 1. rok studia Práce na článku s pracovním názvem "Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model". 2. rok studia Práce na článku s tématem kauzality v časových řadách s ohledem na frekvence a kvantily. 3. rok studia Práce na třetím článku z oblasti kvantitativních financí 4. rok studia Finalizace a obhajoba (malá a velká) disertační práce.

Průběh studia

Plánovaný termín státní doktorské zkoušky: listopad 2018
Plánovaný termín malé obhajoby: listopad 2019
Plánovaný termín obhajoby disertační práce: květen 2020

Povinnosti - studijní plán

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2016/2017
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2016/2017
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2017/2018
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2017/2018
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2018/2019
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2018/2019
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2019/2020
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2019/2020
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2019/2020
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2019/2020
Publikace	---	Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model (SCOPUS submission)	2017/2018
Publikace	---	Systemic Risk in the European Financial and Energy Sector: Dynamic Factor Copula Approach (SCOPUS submission)	2016/2017
Konference	---	Zahraniční vědecké konference	---
Stáž	---	Stáž v rámci projektu ECOCEP a GEMCLIME	2017/2018
Kurz	---	Metodologický seminář pro vyučující na IES	2016/2017
Jiné	---	Grantové aktivity	2016/2017
Jiné	---	Obhajoby	2016/2017
Jiné	---	Oponentury BP a DP	2016/2017
Jiné	---	Studijní dokumenty	2016/2017
Jiné	---	Výuka (TAs)	2016/2017
Publikace	---	Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model (IES WP publikace)	2017/2018
Publikace	---	Systemic Risk in the European Financial and Energy Sector: Dynamic Factor Copula Approach (IES WP publikace)	2016/2017
Publikace	---	Publikace 2. článku (SCOPUS submission)	2018/2019
Publikace	---	Publikace 2. článku (IES WP publikace)	2018/2019
Publikace	---	Publikace 3. článku (SCOPUS submission)	2019/2020
Publikace	---	Publikace 3. článku (IES WP publikace)	2019/2020

Povinnosti specifické pro obor

Publikační výstupy a ostatní studijní povinnosti nutné pro přistoupení ke státní doktorské zkoušce a obhajobě:

Do konce 3. ročníku se přihlásím ke státní doktorské zkoušce (SDZ) tak, abych nejdéle do konce 4. ročníku SDZ složil/a.

Současně nejdéle dva měsíce před termínem SDZ dodám všechny materiály prokazující splnění podmínek přípuštění k SDZ, tj. mít publikovaný či přijatý k publikování (v takovém případě dodám postprint a dobře ověřitelné potvrzení o přijetí k publikaci) alespoň jeden článek ve vědeckém časopise zařazeném v databázi Scopus (či v časopise s nenulovým impakt faktorem z databázi SSCI, SCI) a alespoň jeden vědecký článek v sérii alespoň na úrovni IES Working Papers Series, dále dvě grantové aktivity (dle pravidel stanovených Oborovou radou), alespoň čtyři semestry splněných doktorských seminářů a alespoň čtyři "Teaching Assistantships" (TAs) v rámci alespoň dvou rozdílných předmětů.

Zavazuji se také ke splnění speciálních požadavků, které mi určila Oborová rada (pokud tak učinila) a k docháze na doktorské obhajoby v minimální průměrné účasti 25 % obhajob za celou dobu mého studia.

V době podání přihlášky k malé i velké obhajobě se zavazuji mít publikované či přijaté k publikování alespoň dva články ve vědeckých časopisech zařazených v databázi Scopus (či v časopisech s nenulovým impakt faktorem z databázi SSCI, SCI). Dále se zavazuji mít splněno osm TAs. V době podání přihlášky k malé obhajobě se zavazuji mít dizertaci minimálně v následující podobě. Alespoň jeden dizertační článek je plně hotov, druhý téměř hotov a třetí rozpracován.

Rozpracovaný třetí článek má minimálně jasnou strukturu, metodologii a cíl a signifikantní práce je na něm již odvedena. Pouze články přijaté k publikaci v době, kdy student studuje doktorát na IES, splní tyto podmínky. Všechny články musí být afiliovány k IES FSV UK. Pouze články v odvětvích Economics, Finance a úzce souvisejících budou uznány.

Povinnosti v případě studijního pobytu:

V případě studijního pobytu se předem omluvím koordinátorovi obhajob z neúčasti na obhajobách doktorských studentů, aby má neúčast mohla být omluvena.

Současně v předstihu zažádám Oborovou radu o případné uznání studijních povinností, které plánuji během pobytu splnit.

Oponentury BP a DP: Po celou dobu studia se budu podílet na oponentování bakalářských a diplomových prací.

Studijní dokumenty:

Do 31. 5. každého akademického roku odevzdám vyplněný a školitelem schválený formulář Roční hodnocení plnění ISP, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce. Po zanesení hodnocení Oborovou radou pak formulář Roční hodnocení plnění ISP vytisknu a spolu s mým podpisem a podpisem školitele odevzdám odpovědnému členovi CDS do stanoveného termínu. V případě ukončení přerušení studia a návratu do studia vyplním všechny potřebné dokumenty do jednoho měsíce od data ukončení přerušení (Roční hodnocení plnění ISP a update na další rok).

Obhajoby:

V každém akademickém roce navštívím alespoň 50 % obhajob dizertačních prací konaných na IES FSV UK.

Souhlas s plánem

Školitel/ka

Student/ka

.....

.....

Praha dne

Praha dne

Schváleno oborovou radou doktorského studijního programu (oboru) dne: 25.10.2016

Předseda oborové rady

.....

Praha dne