

**UNIVERZITA KARLOVA**  
**FAKULTA SOCIÁLNÍCH VĚD**

**roční hodnocení plnění individuálního studijního plánu  
studenta doktorského studijního programu**

**za akademický rok 2019/2020**

**ID plánu 12609**

**Student**

Jméno	Mgr. Ing. Matěj Nevrla
E-mail	24247099@fsv.cuni.cz
Fakulta	Fakulta sociálních věd
Studijní program	Ekonomie a finance (P0311D050001)
Původní studijní program	Ekonomické teorie (P6201)
Původní studijní obor	Ekonomie (6201V004)
Datum změny studijního programu	01.11.2019
Standardní délka studia (počet let)	4
Forma studia	prezenční
Datum zahájení doktorského studia	01.09.2016

**Garant studijního programu  
a předseda oborové rady**

Jméno prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

**Školitel**

Jméno doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.  
E-mail jozef.barunik@fsv.cuni.cz  
Katedra / ústav Institut ekonomických studií (23-IES)

**Disertační práce**

<b>Název práce</b>
Three essays on quantile cross-spectral measures of dependence
<b>Postup v přípravě disertační práce</b>
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.
<b>Roční komentář k postupu v přípravě disertační práce</b>

**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	Plnění dle studenta	Splněno dle SIS	Komentář ročního hodnocení	Rok vložení
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2016/2017	splnil 2016/2017	23.05.2017 12:05	---	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2016/2017	splnil 2016/2017	23.05.2017 12:05	---	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2016/2017	splnil 2016/2017	30.01.2017 12:01	---	2016/2017
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2016/2017	splnil 2016/2017	04.01.2017 12:01	---	2016/2017
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018	splnil 2017/2018	29.01.2018 12:01	Výuka předmětů Statistics a Advanced Econometrics.	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018	splnil 2017/2018	18.05.2018 12:05	Výuka předmětů Introductory Statistics a Applied Econometrics.	2016/2017
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2017/2018	splnil 2017/2018	29.01.2018 12:01	---	2016/2017
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019	splnil 2018/2019	24.05.2019 12:05	---	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2018/2019	splnil 2018/2019	02.01.2019 12:01	---	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2018/2019	splnil 2018/2019	---	---	2016/2017
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019	splnil 2018/2019	31.01.2019 12:01	---	2016/2017
Předmět	JED413	Advanced Financial Econometrics II	2019/2020	splnil	---	Požadavky kurzu splněny.	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2019/2020	splnil	---	Výuka Applied Econometrics.	2016/2017
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2019/2020	splnil	04.02.2020 12:02	Výuka Advanced Econometrics.	2016/2017
Předmět	JED412	Advanced Financial Econometrics I	2019/2020	splnil	04.02.2020 12:02	Požadavky kurzu splněny.	2016/2017
Předmět	JED611	Teaching Assistantship (Full) B	2016/2017	splnil 2016/2017	25.05.2017 12:05	Výuka předmětu Introductory Statistics.	2016/2017
Předmět	JSZEE1	Státní doktorská zkouška	2018/2019	splnil	19.09.2019 12:09	Státní doktorská zkouška úspěšně složena.	2019/2020
Předmět	JOBEE1	Obhajoba disertační práce	2020/2021	---	---	---	2019/2020

## Povinnosti - ostatní

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok	Plnění dle studenta	Splněno dle SIS	Komentář ročního hodnocení
Publikace	---	Systemic Risk in the European Financial and Energy Sector: Dynamic Factor Copula Approach (SCOPUS submission) Přepřeruji svou diplomovou práci do formy článku. Ten bude zaslán do žurnálu Economic Modelling (pětiletý IF = 1.046).	2016/2017	splnil 2016/2017	---	---
Kurz	---	Metodologický seminář pro vyučující na IES Dne 19.10.2016 se zúčastním metodologického semináře pro vyučující na IES.	2016/2017	splnil 2016/2017	---	---
Jiné	---	Grantové aktivity V ZS 2016/2017 podám přihlášku do soutěže Grantové agentury UK s předpokládaným tématem "Asset pricing in quantiles and frequencies".	2016/2017	splnil 2016/2017	---	Získán tříletý grant s tématem "Capital Asset Pricing in the Quantile-Frequency Domain".
Jiné	---	Obhajoby Navštívím alespoň 50 % obhajob disertačních prací konaných na IES FSV UK.	2016/2017	splnil 2016/2017	---	Účast na obhajobách alespoň 50% splněna.
Jiné	---	Oponentury BP a DP Budu se podílet na oponentování bakalářských a diplomových prací.	2016/2017	splnil 2016/2017	---	---
Jiné	---	Studijní dokumenty Do 31. 5. tohoto 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).	2016/2017	splnil 2016/2017	---	---

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok	Plnění dle studenta	Splněno dle SIS	Komentář ročního hodnocení
Jiné	---	Výuka (TAs) Výuka ZS 2016/2017: JEB105 - Statistics (1 TA slot - seminář) Výuka LS 2016/2017: zatím neurčený předmět statistického/ekonometrického charakteru (1 TA slot - seminář)	2016/2017	splnil 2016/2017	---	ZS: Statistics (1 TA slot), LS: Applied Econometrics + Introductory Statistics (celkově 2 TA sloty).
Publikace	---	Systemic Risk in the European Financial and Energy Sector: Dynamic Factor Copula Approach (IES WP publikace) Publikace článku v IES WP na základě diplomové práce s předpokládaným názvem "Systemic Risk in the European Financial and Energy Sector: Dynamic Factor Copula Approach".	2016/2017	splnil 2016/2017	---	---
Jiné	---	Oponentury BP a DP Budou se podílet na oponentování bakalářských a diplomových prací.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Jiné	---	Obhajoby Navštívím alespoň 50 % obhajob dizertačních prací konaných na IES FSV UK.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	Účast na obhajobách alespoň 50 % splněna.
Jiné	---	Studijní dokumenty Do 31. 5. daného akademického roku odevzdám vyplněný a školitelem schválený formulář Roční hodnocení plnění ISP, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Jiné	---	Grantové aktivity Pokračování v práci na tříletém grantu Grantové agentury UK s tématem "Capital Asset pricing in the Quantile-Frequency Domain".	2017/2018	splnil 2017/2018	---	Tříletý grant GAUK prodloužen do druhého roku.
Konference	---	Slovak Economic Association Meeting 2017 Zaslání příspěvku "Asset Pricing in Quantile-Frequency Domain" na konferenci Slovak Economic Association Meeting, 2017, Košice.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Konference	---	International Conference on Computational and Financial Econometrics 2017 Zaslání příspěvku "Asset Pricing in Quantile-Frequency Domain" na konferenci 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics, 2017, Londýn.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Jiné	---	Výuka (TAs) ZS: 1-2 semináře (preferované Statistics a případně další, zatím nespecifikovaný, předmět), LS: 1-2 semináře (preferované Applied Econometrics a Introductory Statistics)	2017/2018	splnil 2017/2018	---	ZS: Statistics + Advanced Econometrics (celkově 2 TA sloty), LS: Applied Econometrics + Introductory Statistics (celkově 2 TA sloty).
Jiné	---	Oponentury BP a DP Budou se podílet na oponentování bakalářských a diplomových prací.	2018/2019	splnil 2018/2019	---	---
Jiné	---	Obhajoby Navštívím alespoň 50 % obhajob dizertačních prací konaných na IES FSV UK.	2018/2019	splnil 2018/2019	---	Účast na obhajobách alespoň 50 % splněna.
Jiné	---	Studijní dokumenty Do 31. 5. daného akademického roku odevzdám vyplněný a školitelem schválený formulář Roční hodnocení plnění ISP, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce.	2018/2019	splnil 2018/2019	---	---
Konference	---	Fifth International Symposium in Computational Economics and Finance in Paris Aktivní účast na konferenci Fifth International Symposium in Computational Economics and Finance v Paříži.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Jiné	---	Grantové aktivity Pokračování v práci na tříletém grantu Grantové agentury UK s tématem "Capital Asset pricing in the Quantile-Frequency Domain".	2018/2019	splnil 2018/2019	---	Tříletý grant GAUK prodloužen do třetího roku.
Jiné	---	Výuka (TAs) ZS: 1-2 semináře (preferované Statistics a Advanced Econometrics), LS: 1-2 semináře (preferované Applied Econometrics a Introductory Statistics)	2018/2019	splnil 2018/2019	---	ZS: Statistics + Advanced Econometrics (celkově 2 TA sloty), LS: Applied Econometrics (1 TA slot).

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok	Plnění dle studenta	Splněno dle SIS	Komentář ročního hodnocení
Konference	---	International Conference on Computational and Financial Econometrics 2018 Zaslání příspěvku "Asset Pricing in Quantile-Frequency Domain" na konferenci 12th International Conference on Computational and Financial Econometrics, 2018, Pisa.	2018/2019	splnil 2018/2019	---	---
Publikace	---	Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model (IES WP publikace) Příspěvek do IES WP s předpokládaným názvem "Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model".	2018/2019	splnil 2018/2019	---	---
Stáž	---	Stáž v rámci projektu ECOCEP a GEMCLIME	2018/2019	splnil 2018/2019	---	Stáž v rámci projektu GEMCLIME na Rady School of Management, UC San Diego v období 1.5.2019 - 16.8.2019.
Konference	---	Zahraniční vědecké konference Do konce 4. ročníku se aktivně zúčastním nejméně 2 zahraničních vědeckých konferencí.	2017/2018	splnil 2017/2018	---	---
Publikace	---	Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model (SCOPUS submission) Během prvního roku studia budu pracovat na publikaci s pracovním názvem "Quantile Cross-Spectral Approach to the Capital Asset Pricing Model". Článek bude zaslán do některého SCOPUS žurnálu.	2019/2020	splnil	---	Článek byl zaslán do The Review of Financial Studies, kde byl po review procesu odmítnut. Na základě posudků je článek revidován a v nejbližší době bude zaslán do Journal of Financial Econometrics.
Jiné	---	Oponentury BP a DP Budu se podílet na oponování bakalářských a diplomových prací.	2019/2020	splnil	---	Oponoval jsem 1 bakalářskou práci.
Jiné	---	Obhajoby Navštívím alespoň 50 % obhajob disertačních prací konaných na IES FSV UK.	2019/2020	splnil	---	Účast na obhajobách alespoň 50 % splněna.
Jiné	---	Studijní dokumenty Do 31. 5. daného akademického roku odevzdám vyplněný a školitelem schválený formulář Roční hodnocení plnění ISP, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce.	2019/2020	splnil	---	Studijní dokumenty odevzdány včas.
Jiné	---	Výuka (TAs) ZS: 1-2 semináře (preferované Statistics a Advanced Econometrics), LS: 1-2 semináře (preferované Applied Econometrics a Introductory Statistics)	2019/2020	splnil	---	Výuka Advanced Econometrics a Applied Econometrics.
Konference	---	International Conference on Computational and Financial Econometrics 2019 Zaslání příspěvku "Downside risk network asset pricing" na konferenci 13th International Conference on Computational and Financial Econometrics, 2019, Londýn.	2019/2020	splnil	---	Aktivní účast na konferenci. Název příspěvku: "Quantile Spectral Beta: A Tale of Tail Risks, Investment Horizons, and Asset Prices".
Publikace	---	Publikace 3. článku (IES WP publikace) Publikace 3. disertačního článku v IES WP. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2018/2019.	2020/2021	---	---	Článek zatím není dokončen, plánované dokončení v letním semestru 2020/2021.
Publikace	---	Publikace 3. článku (SCOPUS submission) Zaslání 3. disertačního článku do zahraničního časopisu v databázi SCOPUS. Název článku upřesním dodatku na ak. rok 2018/2019.	2020/2021	---	---	Článek zatím není dokončen, plánované dokončení v letním semestru 2020/2021.
Publikace	---	Publikace 2. článku (IES WP publikace) Publikace 2. disertačního článku v IES WP. Téma článku bude kauzalita v časových řadách v kontextu kvantilů a frekvencí společného rozdělení. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2017/2018.	2020/2021	---	---	Článek je rozpracován a bude dokončen během zimního semestru 2020/21 a publikován v IES WP. Článek se zabývá idiosynkratickým kvantilovým rizikem a jeho oceněním.
Publikace	---	Publikace 2. článku (SCOPUS submission) Zaslání 2. disertačního článku do zahraničního časopisu v databázi SCOPUS. Téma článku bude kauzalita v časových řadách v kontextu kvantilů a frekvencí společného rozdělení. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2017/2018.	2020/2021	---	---	Článek je rozpracován a bude dokončen během zimního semestru 2020/21 a odeslán k publikaci do zahraničního časopisu v databázi SCOPUS. Článek se zabývá kvantilovým idiosynkratickým rizikem a jeho oceněním.
Jiné	---	Oponentury BP a DP Budu se podílet na oponování bakalářských a diplomových prací.	2020/2021	---	---	---

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok	Plnění dle studenta	Splněno dle SIS	Komentář ročního hodnocení
Jiné	---	Studijní dokumenty Do 31.5 tohoto akademického roku odevzdám vyplněný a školitelem schválený formulář Roční hodnocení plnění ISP, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce. V případě ukončení, přerušení studia a návratu do studia vyplním všechny potřebné dokumenty do jednoho měsíce od data ukončení přesrušení (Roční hodnocení plnění ISP a update na další rok).	2020/2021	---	---	---
Jiné	---	Obhajoby Navštívím alespoň 50% obhajob dizertačních prací konaných na IES FSV UK.	2020/2021	---	---	---

### Další komentáře ročního hodnocení

Typ	Komentář ročního hodnocení
Roční hodnocení	---

### Výsledné hodnocení plnění plánu

Typ	Komentáře a hodnocení	
Shrnutí studenta	Na začátku akademického roku jsem složil státní doktorskou zkoušku. Během uplynulého roku jsem zaslal k publikaci svůj první dizertační článek. Rozpracované jsou také 2 další, které by měly být dokončeny během následujícího roku tak, abych do konce 5. roku studia obhájil svou dizertační práci. Ostatní povinnosti nutné k úspěšnému ukončení studia (výuka, konference, granty) mám již splněny.	-
Návrh školitele	Matěj bez výhrad a ukázkově plní svoje studijní povinnosti, zejména pokračuje v úspěšném výzkumu. V uplynulém roce se soustředil zejména na dopracování a zaslání prvního článku, který získal řadu velmi cenných připomínek oponentů v řízení Review of Financial Studies. Přepřacovaný článek zaslal do prestižního Journal of Financial Econometrics, a dále se soustředil na práci na dalších 2 kapitolách, které budou dokončeny v dalším roce. Matěj významně přispívá i k chodu CDS, kvalitní výukou dál k seminářům, a plní si všechny svoje povinnosti ukázkově. K studiu nemám výhrady.	A
Rozhodnutí oborové rady	Schváleno za CDS.	A

Ve smyslu č. 10 odst. 8 Studijního a zkušebního řádu Univerzity Karlovy student plní individuální studijní plán.

Oborová rada navrhuje POKRAČOVÁNÍ studia.

Školitel/ka

doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.

22.05.2020

Schváleno oborovou radou doktorského studijního programu (oboru) dne: 21.09.2020

Předseda oborové rady

prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

02.10.2020

Student/ka

Mgr. Ing. Matěj Nevrla

20.05.2020

Garant studijního programu

prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

02.10.2020

**UNIVERZITA KARLOVA**  
**FAKULTA SOCIÁLNÍCH VĚD**

**Dodatek č. 2 ID plánu 12609**  
**za akademický rok 2019/2020**

k individuálnímu studijnímu plánu schválenému oborovou radou dne: 21.09.2020

Jméno studenta/ky doktorského studijního programu: Mgr. Ing. Matěj Nevrla

Narozen/a: 31.5.1990, Ostrava

Typ	Změny individuálního studijního plánu (nová studijní povinnost, zrušená studijní povinnost, změna termínu splnění studijní povinnosti)	původní plánovaný termín*	nový termín splnění*
Publikace	Zaslání 3. disertačního článku do zahraničního časopisu v databázi SCOPUS. Název článku upřesním dodatku na ak. rok 2018/2019.	2019/2020	2020/2021
Publikace	Publikace 3. disertačního článku v IES WP. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2018/2019.	2019/2020	2020/2021
Publikace	Zaslání 2. disertačního článku do zahraničního časopisu v databázi SCOPUS. Téma článku bude kauzalita v časových řadách v kontextu kvantilů a frekvencí společného rozdělení. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2017/2018.	2019/2020	2020/2021
Publikace	Publikace 2. disertačního článku v IES WP. Téma článku bude kauzalita v časových řadách v kontextu kvantilů a frekvencí společného rozdělení. Název článku upřesním v dodatku na ak. rok 2017/2018.	2019/2020	2020/2021
Předmět	Státní doktorská zkouška	---	2018/2019
Předmět	Obhajoba disertační práce	---	2020/2021
Jiné	Oponentury BP a DP	---	2020/2021
Jiné	Studijní dokumenty	---	2020/2021
Jiné	Obhajoby	---	2020/2021

**Školitel/ka**

doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.

22.05.2020

**Student/ka**

Mgr. Ing. Matěj Nevrla

20.05.2020

Schváleno oborovou radou doktorského studijního programu (oboru) dne: 21.09.2020

**Předseda oborové rady**

prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

02.10.2020

**Garant studijního programu**

prof. Ing. Evžen Kočenda, M.A., Ph.D., DSc.

02.10.2020

\* Vysvětlující poznámka:

- v případě nové studijní povinnosti bude kolonka "původní plánovaný termín" proškrtnuta a datum plánovaného splnění zapsán do kolonky "nový termín splnění"
- v případě zrušení studijní povinnosti bude v kolonce "původní plánovaný termín" zapsáno datum původně uvedené v ISP a do kolonky "nový termín splnění" zapsáno "nový termín splnění"