



FAKULTA
SOCIÁLNÍCH VĚD
Univerzita Karlova

Zápis o části závěrečné státní zkoušky Záznam o průběhu obhajoby

Akademický rok: 2022/2023

Jméno a příjmení studenta: Bc. Vesna Jarina
Identifikační číslo studenta: 86851220

Typ studijního programu: navazující magisterský
Studijní program: Ekonomie a finance se specializací Finanční trhy a datová analýza

ID studia: 706399

Název práce: Geopolitical risk and financial markets: trends, co-movements and effects
Pracoviště práce: Institut ekonomických studií (23-IES)
Jazyk práce: angličtina
Jazyk obhajoby: čeština
Vedoucí: prof. Roman Horváth, Ph.D.
Oponent(i): Mgr. Lukáš Vácha, Ph.D.
Datum obhajoby: 21.09.2023 **Místo obhajoby:** Praha
Termín: řádný

Průběh obhajoby: The student initiated her presentation by stressing the current importance of the topic and formulating the four research hypotheses. The data has been described well, specifically focusing on the GPR index showcase. The details of all four methodological approaches were excellently outlined. The results of the GARCH-based analysis were discussed in detail, and the results of the other methodological approaches were briefly summarized. The committee subsequently focused on the main points summarized in the opponent report, specifically the number of observations on the extreme quantiles, the interpretation of the "persistence" parameters beta close to 1 (alternatively, $\alpha + \beta > 1$) suggesting a potential nonstationarity issue, the interpretation of the mean equation delta parameter, and why the variance equation zeta was finally not included in the models. The student responded to all these questions well but also admitted the potential weaknesses and imperfections. All in all, the committee appreciated the very good quality and the outstandingly strong methodological background of the thesis and the presentation and decided on a grade B.

Výsledek obhajoby:	výborně (B)	
Předseda komise:	doc. PhDr. Adam Geršl, Ph.D. (přítomen)
Členové komise:	prof. Ing. et Ing. Luboš Komárek, M.Sc., MBA, Ph.D. (přítomen)
	prof. PhDr. Ladislav Krištofek, Ph.D. (přítomen)
	PhDr. Mgr. Jiří Kukačka, Ph.D. (přítomen)