

UNIVERZITA KARLOVA V PRAZE

FAKULTA SOCIÁLNÍCH VĚD

individuální studijní plán
studenta doktorského studijního programu

ID plánu 9359

Student

Příjmení, jméno (titul)	Mgr. Ing. Adam Kučera
E-mail	avtkucera@gmail.com
Fakulta	Fakulta sociálních věd
Studijní program	Ekonomické teorie (P6201)
Studijní obor	Ekonomie (6201V004)
Standardní délka studia (počet let)	4
Forma studia	prezenční
Datum zahájení doktorského studia	21.09.2015

Předseda oborové rady

Příjmení, jméno (titul)	prof. RNDr. Jan Ámos Víšek, CSc.
-------------------------	----------------------------------

Školitel

Příjmení, jméno (titul)	prof. Ing. Evžen Kočenda, Ph.D.
E-mail	Evzen.Kocenda@fsv.cuni.cz
Katedra / ústav	Institut ekonomických studií (23-IES)

Konzultant

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

Disertační práce

Název práce

Topics in Joint Macroeconomic and Financial Modeling

Postup v přípravě disertační práce

Synopse:

V přístupech k modelování makroekonomických a finančních veličin donedávna vládla dichotomie. Finanční modely byly stavěny zejména na rizikově neutrálním přístupu, zatímco měnová a fiskální politika přikládala finančním proměnným spíše okrajovou roli. To ztížilo správný odhad důsledků vzájemných vlivů: Jaký bude mít změna inflačního cíle centrální banky dopad na ceny dluhopisů? Nakolik riziková averze investorů ovlivňuje efektivitu měnové či fiskální politiky? Změny zahrnutí finančního sektoru do současných strukturálních makroekonomických modelů jejich implikace? Absence odpovědí na podobné otázky se ukázala jako kritická v dekádě předcházející nedávný ekonomický kolaps: americká měnová politika nedokázala efektivně ovlivnit delší konec výnosové křivky a tedy účinně působit na ekonomickou dynamiku; naopak nezahrnutí trendů fiskální a měnové politiky do risk managementu finančních institucí přispělo ke vzniku finanční bubliny a následným kolapsům.

Práce navazuje na rozvoj makro-finančních modelů, které si dávají za cíl rozšířit stávající modely právě o makro-finanční vztahy. Práce bude zaměřena na zachycení vzájemného vztahu mezi cenami finančních aktiv, časovou strukturou úrokových měr, rizikovou premií, monetární a fiskální politikou, a to jak z pohledu empirického zachycení závislosti a kauzality, tak i jejich vysvětlení v rámci strukturálního modelu.

Základní literatura:

Ang, A. and M. Piazzesi (2003): "A No-Arbitrage Vector Autoregression of Term Structure Dynamics with Macroeconomic and Latent Variables." Journal of Monetary Economics 50: 745-787.

Christiano, L., R. Motto, and M. Rostagno (2010): "Financial Factors in Economic Fluctuations", ECB Working Paper 1192.

Wright, Jonathan H. 2011. "Term Premia and Inflation Uncertainty: Empirical Evidence from an International Panel Dataset." American Economic Review 101 (4): 1514-34.

Forma a rozsah práce:

Práce je plánována v rozsahu 150-200 stran, formou bude představovat soubor tří článků.

Časový plán zpracování disertační práce:

1. rok studia:

Práce na prvním dis. článku s předpokládaným názvem "Empirical Study of Bond Prices: Macroeconomic Approach to Solve the Term Premium Puzzle".

2. rok studia:

Práce na druhém dis. článku s předpokládaným názvem "Asset Prices, Risk Premia and Macroeconomic Uncertainty".

3. rok studia:

Dokončení disertace třetím článkem "Economic Policy, Financial Risks and Expectations: Structural Approach".

4. rok studia:

Finalizace a obhajoba práce.

Průběh studia

Plánovaný termín státní doktorské zkoušky: listopad 2017
 Plánovaný termín malé obhajoby: listopad 2018
 Plánovaný termín obhajoby disertační práce: květen 2019

Povinnosti - studijní plán

Typ	Kód	Název, podrobnosti	Ak. rok
Předmět	JED414	Kvantitativní metody I	2015/2016
Předmět	JED415	Kvantitativní metody II	2015/2016
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2015/2016
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2015/2016
Předmět	JED611	Teaching Assistantship (Full) B	2015/2016
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	JED611	Teaching Assistantship (Full) B	2016/2017
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2016/2017
Předmět	JED414	Kvantitativní metody I	2017/2018
Předmět	JED415	Kvantitativní metody II	2017/2018
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018
Předmět	JED511	Teaching Assistantship (Full) A	2017/2018
Předmět	JED413	Summer Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019
Předmět	JED412	Winter Semester Nonlinear Dynamic Economic Systems: Theory and Applications	2018/2019
Publikace	---	Empirical Study of Bond Prices: Macroeconomic Approach to Solve the Term Premium Puzzle (IES WP)	2015/2016
Publikace	---	Empirical Study of Bond Prices: Macroeconomic Approach to Solve the Term Premium Puzzle (Scopus)	2015/2016
Publikace	---	Examining the Impact of the Government Spending on the Term Structure of Interest Rates: A Macro-Finance Approach (jointly with A.Maršál)	2015/2016
Publikace	---	Interest Rate Modelling and Forecasting: Macro-Finance Approach (IES WP)	2015/2016
Konference	---	Účast na konferenci v prvním/druhém roce	2015/2016
Jiné	---	Přihláška do GAUK v 1. roce studia	2015/2016
Jiné	---	Studijní dokumenty	2015/2016
Publikace	---	Asset Prices, Risk Premia and Macroeconomic Uncertainty (IES WP)	2016/2017
Publikace	---	Asset Prices, Risk Premia and Macroeconomic Uncertainty (Scopus)	2016/2017
Jiné	---	Grantová aktivita (GAUK) na téma "Macroeconomic Policy and Financial Risks"	2016/2017
Publikace	---	Macroeconomic Policy and Financial Risks: Structural Approach (IES WP)	2017/2018
Publikace	---	Macroeconomic Policy and Financial Risks: Structural Approach (Scopus)	2017/2018
Konference	---	Do konce čtvrtého roku se aktivně zúčastním alespoň dvou zahraničních vědeckých konferencí	---
Stáž	---	Stáž v druhém až čtvrtém roce studia	---
Jiné	---	Obhajoby	2015/2016
Jiné	---	Oponentury BP a DP	2015/2016
Jiné	---	Výuka (TAs)	2015/2016

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 připuštění 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 docházce 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 oponování bakalářských a diplomových prací.

Studijní dokumenty:

Do 31. 5. každého akademického roku odevzdám vytištěný, vyplněný a školitelem podepsaný formulář Roční hodnocení plnění ISP + Dodatek, ve kterém současně upřesním průběh doktorského studia v následujícím akademickém roce.

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: 26.10.2015

Předseda oborové rady

.....

Praha dne