

711

RNDr. Martin Šmíd, Ph.D. (naroz. 1970)

Ústav teorie informace a automatizace AV ČR, v. v. i.

finanční ekonometrie

návrh podává: Ústav teorie informace a automatizace AV ČR, v. v. i.

Tématem disertační práce kandidáta (obhájena 2004) byly modely rozhodování za neurčitosti, konkrétně přibližné výpočty úloh stochastického programování. Výsledky disertace byly shrnuty v časopiseckých publikacích Kaňková a Šmíd (2004) a Šmíd (2006).

Vedle stochastického programování se kolega Šmíd věnuje mikrostruktuře finančních trhů – konkrétně studiu vlastností modelů trhů s limitními objednávkami – v současné době připravuje souhrnnou publikaci těchto výsledků.

V poslední době se pozornost M. Šmída soustřeďuje též na modely výběru portfolia na výše uvedených trzích – první výsledky jsou shrnuty v člancích Šmíd (2007) a Šmíd (2007).

V. Kaňková a M. Šmíd. On approximation in multistage stochastic programs: Markov dependence. *Kybernetika*, 40(5):625-638, 2004.

M. Šmíd. Expected loss in the discretization of multistage stochastic programming probléme – estimation and convergence rate, 2006. Accepted to ANNOR.

M. Šmíd. Un uselessness of limit orders. *Bulletin of the Czech Econometric Society*, 24:47-57, 2007.

M. Šmíd. Are limit orders rational? *Acta Oeconomica Pragensia*, 14(4):32-38, 2007b.