

# Report on Bachelor / Master Thesis

Institute of Economic Studies, Faculty of Social Sciences, Charles University in Prague

Student:	Bc. Petr Macek
Advisor:	PhDr. Petr Teplý, Ph.D.
Title of the thesis:	Counterparty risk under Basel III

## **OVERALL ASSESSMENT** (provided in English, Czech, or Slovak):

Petr Macek ve své diplomové práci analyzuje aktuální téma kreditního rizika protistrany v rámci regulace Basel III. Diplomant v rámci své práce nejprve široce diskutuje teoretický základ svého výzkumu (Basel III, OTC market, Stress testing). V empirické části práce autor aplikuje vlastní metodu stress testingu pro výpočet kapitálového požadavku.

Autor prokázal schopnost práce s relevantní literaturou, v diplomové práci jsou využity ekonometrické postupy vyučované v průběhu studia na IES. Dílčí výsledky i závěry práce jsou srozumitelně formulovány. Z formálního hlediska je práce nadstandardní, zejména díky velmi dobré práci s odbornou literaturou.

Celkově předkládaná diplomová práce splňuje veškeré kvalitativní i kvantitativní požadavky kladené na studenta IES a dle mého názoru může být použita jako podklad pro budoucí odborný článek. Z těchto důvodů doporučuji práci k obhajobě a navrhuji známku **Výborně**.

## **SUMMARY OF POINTS AWARDED** (for details, see below):

CATEGORY	POINTS
Literature (max. 20 points)	19
Methods (max. 30 points)	27
Contribution (max. 30 points)	25
Manuscript Form (max. 20 points)	18
<b>TOTAL POINTS</b> (max. 100 points)	<b>89</b>
<b>GRADE</b> (1 – 2 – 3 – 4)	<b>1</b>

**NAME OF THE REFEREE:**

**DATE OF EVALUATION:**

---

**Referee Signature**

### **EXPLANATION OF CATEGORIES AND SCALE:**

**LITERATURE REVIEW:** *The thesis demonstrates author's full understanding and command of recent literature. The author quotes relevant literature in a proper way.*

Strong                  Average                  Weak  
20                          10                          0

**METHODS:** *The tools used are relevant to the research question being investigated, and adequate to the author's level of studies. The thesis topic is comprehensively analyzed.*

Strong                  Average                  Weak  
30                          15                          0

**CONTRIBUTION:** *The author presents original ideas on the topic demonstrating critical thinking and ability to draw conclusions based on the knowledge of relevant theory and empirics. There is a distinct value added of the thesis.*

Strong                  Average                  Weak  
30                          15                          0

**MANUSCRIPT FORM:** *The thesis is well structured. The student uses appropriate language and style, including academic format for graphs and tables. The text effectively refers to graphs and tables and disposes with a complete bibliography.*

Strong                  Average                  Weak  
20                          10                          0

### **Overall grading:**

TOTAL POINTS	GRADE		
81 – 100	<b>1</b>	= excellent	= výborně
61 – 80	<b>2</b>	= good	= velmi dobře
41 – 60	<b>3</b>	= satisfactory	= dobře
0 – 40	<b>4</b>	= fail	= nedoporučuji k obhajobě