

UNIVERZITA KARLOVA

Fakulta sociálních věd

**Zápis o části státní závěrečné zkoušky
Záznam o průběhu obhajoby**

Akademický rok: 2017/2018

Jméno a příjmení studenta: Bc. Petr Rýgr
Datum narození: 12.09.1992
Identifikační číslo studenta: 32233425

Typ studijního programu: navazující magisterský
Studijní program: Ekonomické teorie
Studijní obor: Ekonomie a finance
Specializace: Finance, finanční trhy a bankovníctví
Identifikační číslo studia: 480762

Název práce: Empirical evidence on pricing of contingent convertibles
Pracoviště práce: Institut ekonomických studií
Jazyk práce: angličtina
Jazyk obhajoby: čeština
Vedoucí: doc. PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.
Oponent(i): doc. PhDr. Petr Teplý, Ph.D.

Datum obhajoby : 31.01.2018 **Místo obhajoby :** Praha

Průběh obhajoby: The student presented his master thesis research focusing first on the motivation, 3 goals of the thesis, details of the dataset, a brief description of the methodology, and issues of the trigger level estimation. Volatility modeling methodology was discussed and the student presented details of the model with a main focus on the model calibration. The committee then discussed topics of data frequency, identical spread on Credit Suisse vs HSBC, details of the calibration procedure, and details of the calibration of the capital adequacy. The student was able to react to all these questions excellently. The final decision of the committee based on the student's performance during the defense is A.

Výsledek obhajoby: výborně

Předseda komise: prof. Ing. Michal Mejstřík, CSc. (přítomen)

Členové komise: Ing. Vilém Semerák, M.A., Ph.D. (přítomen)

Mgr. Bc. Magda Pečená, Ph.D. (přítomen)

PhDr. Mgr. Jiří Kukačka, Ph.D. (přítomen)