

POSUDEK VEDOUcíHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Non-homogeneous Poisson process – estimation and simulation

Autor: Bc. Anna Vedyushenko

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce pojednává o odhadování parametrických intenzit nehomogénných Poissonových procesů a následně o generování dob příchodů nehomogénných Poissonových procesů. Okrem teoretického popisu je v práci demonštrovaná praktická aplikácie metod na aktuárske reálne dáta.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Téma práce. Relatívne obtiažne téma bolo spracované nadštandardne a bezpochyby spĺňa zadanie práce.

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riešiteľky práce spočíva v prehľadnom predstavení spôsobov odhadovania parametrických intenzít a v porovnaní rôznych metod simulácie nehomogénneho Poissonovho procesu. Navyše študentka všetky teoretické prístupy naprogramovala a aplikovala na reálne dáta z českého poistného trhu.

Matematická úroveň. Práce je na vysokej matematickej úrovni. Obsahuje rigorózne a korektne sformulovaný matematický text.

Práce se zdroji. Bibliografické zdroje v práci sú správne citované.

Formální úprava. Grafická i štylistická úprava práce je výborná.

PŘIPOMÍNKY A OTÁZKY

Žiadne.

ZÁVĚR

Práci považuji za vynikající/velmi dobrou/průměrnou/podprůměrnou/nevyhovující a doporučuji ji uznat jako diplomovou práci.

Návrh klasifikace vedoucí sdělí předsedovi zkušební komise.

Jméno vedoucího: RNDr. Michal Pešta, Ph.D.

Pracoviště: KPMS MFF UK

Datum: 17. 8. 2018