

Posudek na diplomové práci Anny Ringrelovoy
„ Proces rizika s náhodným příjmem “

Autorka se študuje proces rizika. Velká část prací je věnovaná popisu klasický rizikový modelu. Uvedeny ruinování –konvolučně formule a Beekmanova konvolučně formule. Jsou tam Cramér-Lundbergova, Beekman-Bowersova aproximací.

Centrální část práce je věnovaná procesu rizika s náhodným příjmem, a v příkladu uvedeno, že pravděpodobnost ruinování muže být jiná, než v klasický modelu. Je to nový a zajímavý výsledek.

Myslím že diplomová práce je dodržena kvalitně, a její autorka zaslouží titulu magistr.

Vedoucí, Dr. Sc., Profesor Lev Klebanov.



Já myslím že zkouška muže 1 když obhajoba bude udělána kvalitně.