

V této diplomové práci zavádíme Poissonův shlukový proces pomocí kótovaného Poissonova procesu. Model představujeme pomocí obecné definice a poté se věnujeme interpretaci tohoto modelu v pojistné matematice v neživotním rezervování. Určujeme budoucí predikce a střední čtvercové chyby. Pro praktické použití modelu navrhuje odhady těchto predikcí. Popisujeme také alternativní rezervovací metody, se kterými porovnááme výsledky v simulační studii a v aplikaci modelu na reálných datech. Zvolenými alternativními metodami jsou Mackův chain ladder a zobecněný lineární model.