

Posudek na diplomovou práci Lucie Fuchsové „Velké odchylky a jejich aplikace v pojistné matematice“

Diplomová práce je zaměřena na aplikace teorie velkých odchylek v pojistné matematice. Práce se skládá z šesti kapitol, z nich čtyři jsou přehledové a dvě (poslední) kapitoly jsou věnovány počítačovému modelování pravděpodobnosti ruinování a vysokých škod. Tato práce by nebyla špatná, i když existují některé nepříjemné chyby:

1. Na straně 14 autorka pozorovala Paretovo rozdělení pro všechna kladná α , ale kalkulace střední hodnoty přežití byla provedena jenom pro $\alpha > 1$. Je zřejmé, že tato funkce musí být nekonečná pro ostatní α .
2. Autorka píše často střední hodnoty a rozptyl bez předpokladu jejich existence.
3. Na straně 19 autorka ukazuje, že Věta 3.1.4 byla daná Petrovem v knize 11. Tato kniha byla publikovaná v roce 1995, ale tato Věta byla daná Petrovem v roce 1954.

Věřím, že výše uvedené chyby nemají vliv na pozitivní hodnocení práce. Práce sama o sobě splňuje všechny požadavky pro magisterské práce a její autorka si zaslouží udělení magisterského titulu.

19.5.2011

Profesor Lev Klebanov DrSc.