

Posudek vedoucího na diplomovou práci Bc. Renaty Šiklové „Mnohorozměrná teorie extrémních hodnot“

Práce se zabývá modelováním extrémních hodnot ve vícerozměrných datech. K modelování závislostí užívá nástroje kopul. Zpracované téma je teoreticky značně náročné a výrazně přesahuje matematický aparát, který je obsahem přednášek magisterského studia finanční a pojistné matematiky. Studentka si prostudovala velké množství relevantní literatury a vybrané poznatky přiměřeným způsobem popsala v teoretické části práce.

Vlastním přínosem autorky je rozsáhlá numerická studie zpracovaná na reálných datech představovaných srážkovými úhrny měřenými na různých meteorologických stanicích v rámci ČR. Modelování ve čtvrté kapitole má ze zřejmých důvodů zejména ilustrovat teorii, nicméně je rovněž zdařilým náhledem na principy fungování komerčních katastrofických modelů využívaných například v pojišťovnictví.

Autorka pracovala na aplikační části práce s nebývalým zájmem. Celou studii navrhla a zpracovala zcela samostatně a po celou dobu práce jsem neměla pochybnosti o tom, že používaným postupům rozumí. I na základě svých dosavadních zkušeností s vedením či oponováním diplomových prací na oboru Finanční a pojistná matematika si dovoluji označit její výkon za značně nadprůměrný.

Celkově práci hodnotím jako vynikající a doporučuji, aby byla uznána za práci diplomovou.

V Praze 11.9.2013

RNDr. Lucie Mazurová, Ph.D.