

POSUDEK OPONENTA BAKALÁŘSKÉ PRÁCE

Název: Rekurzivní výpočet složených rozdělání

Autor: Michal Sekera

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce je zameraná na výpočet zložených rozdělání pomocou Panjerovej rekurzie, ktorá je priamo aplikovateľná iba v prípade diskretných rozdělání z tried $(a, b, 0)$ a $(a, b, 1)$. Ďalej sú predstavené diskretizačné metódy pre spojité rozdělania umožňujúce následné použitie Panjerovej rekurzie.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Téma práce. Téma bolo prehľadne a zrozumiteľne spracované. Bezpochyby splňa zadanie práce.

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riešiteľa práce spočíva v prehľadnom spísaní prístupu na výpočet distribúcie agregovaných škôd na jednom mieste a v jednotnom značení. Teoretické zhrnutia sú aplikované pri výpočte zaistného v XL-zaijstení so saturáciami a na stanovení kapitálového požiadavku v poisťovníctve.

Matematická úroveň. Práce je na slušnej matematickej úrovni. Obsahuje rigorózne a korektné 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

1. Jeden literárny zdroj je obhájená bakalárska práca na MFF UK. Bolo by korektnejšie referovať na originálnejšie zdroje poznatkov využívaných v bakalárskej práci.
2. Na niektorých miestach v práci je namiesto destinnej čiarky, desatinná bodka. Ale vo väčšine prípadov je správne použitá desatinná čiarka.
3. Je počet typov pravdepodobnostných rozdělání v triede $(a, b, 0)$ konečný? Ak áno, ktoré sú to? Ak nie, prečo?
4. Je pravda, že do triedy $(a, b, 1)$ patria len rozdělania z triedy $(a, b, 0)$, v nule modifikované rozdělania z triedy $(a, b, 0)$ a useknuté rozdělania z triedy $(a, b, 0)$? Alebo je trieda $(a, b, 1)$ ešte o niečo bohatšia? Zdôvodnite.

ZÁVĚR

Práci považuji za vynikající/~~velmi dobrou~~/~~průměrnou~~/~~podprůměrnou~~/~~nevyhovující~~ a doporučuji ji uznať jako bakalárskou práci.

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

Pracoviště: KPMS MFF UK

Datum: 30. 5. 2015