

POSUDEK VEDOUcíHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Claims reserve volatility and bootstrap with application on historical data with trend in claims development
Autor: Bc. Kateřina Malíková

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce pojednává o využití stochastických rezervovacích metod na data s trendem vo vývoji škôd. Jednotlivé rezervovacie techniky sú predstavené po teoretickej stránke a následne je uvedený podrobný postup pre stanovenie odhadu celkových škôd a rezerv, kde nepozorované „chvostové“ hodnoty sú extrapolované pomocou odhadnutého trendu. Na záver je demonštrovaná praktická aplikácie teórie na reálne data.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Téma práce. Relatívne obtiažne téma bolo spracované nadštandardne a bezpochyby spĺňa zadanie práce.

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riešiteľky práce spočíva v porovnaní rôznych vychladzovacích a predikčných metod v kontexte stochastického rezervovania škôd a to ako po stránke matematickej i výpočetnej. Navyše niektoré prístupy boli doposiaľ navrhnuté len teoreticky, prípadne matematicky popísané veľmi vágne a neformálne – riešiteľka jednotne formalizovala tieto stochastické modely a následne ich naprogramovala.

Matematická úroveň. Práce je na slušnej matematickej úrovni. Obsahuje rigorózne a korektne sformulovaný matematický text.

Práce se zdroji. Bibliografické zdroje v práci sú väčšinou správne citované, až na neštandardné zdroje ako napríklad dokument z webu.

Formální úprava. Grafická i stylistická úprava práce je výborná.

PŘIPOMÍNKY A OTÁZKY

Žiadne.

ZÁVĚR

Práci považuji za vynikající/velmi dobrou/průměrnou/podprůměrnou/nevyhovující a doporučuji ji uznat jako diplomovou práci.

Návrh klasifikace vedoucí sdělí předsedovi zkušební komise.

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

Pracoviště: KPMS MFF UK

Datum: 17. 1. 2019