

POSUDEK VEDOUcíHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Alternativní přístup k výpočtu BEL pro životní pojištění

Autor: Bc. Zuzana Teichmannová

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce pojednává o novom přístupe k aproximácii hodnoty nejlepšího odhadu závazkov (Best Estimate of Liabilities – BEL) v životnom poistení, ktorý využíva koncept parciálnych durácií. Ďalej sa v práci hodnotí, či zvolený postup aproximácie odhaduje hodnotu BEL dostatočne presne a umožňuje tak získať predstavu o výslednej hodnote v kratšom čase.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

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

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riešiteľky práce spočíva v naprogramovaní predstavených prístupov k aproximácii hodnoty BEL v životnom poistení. Ďalej vyzdvihujem simulačnú štúdiu s komentármi numerických výsledkov. Oceňujem taktiež prílohu Python skriptov s použitým kódom, vstupmi a výstupmi.

Matematická úroveň. Práce je na vysokej matematickej úrovni. Obsahuje rigorózne a korektne 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

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: doc. RNDr. Michal Pešta, Ph.D.

Pracoviště: KPMS MFF UK

Datum: 24. 1. 2021