

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor: Jaroslav Dufek

Název práce: Pokročilejší techniky agregace rizik

Jméno vedoucího: RNDr. Ing. Iva Justová, Ph.D.

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji

uznat jako diplomovou.

Připomínky a vyjádření vedoucího:

Diplomant se ve své práci zaměřil na praktické využití teorie stochastických mezí. Problematika určování dolní a horní hranice pro hodnotu v riziku součtu několika závislých rizik je aktuálním tématem především v souvislosti s novou regulací v pojišťovnictví – Solventností II, může být ale využita i v jiných oblastech, např. při sjednávání zajištění.

Student přistupoval k danému tématu samostatně a poradil si i s problémy nastalými během výpočtu. V práci kladně hodnotím zejména přehledný popis a řešení komplexnějších problémů a zároveň stručné shrnutí základních nebo naopak rozšiřujících informací.

V Praze dne 20. 5. 2012

RNDr. Ing. Iva Justová, Ph.D.