

Cílem této práce je popsat metody výpočtu variability odhadu rezervy na pojistná plnění v neživotním pojištění. Práce se zabývá popisem tří postupů pro výpočet variability odhadu rezervy – Mackovým stochastickým modelem Chain-Ladder, zobecněnými lineárními modely a metodou bootstrap. Práce obsahuje jak teoretickou, tak praktickou část, která je věnována aplikaci zmíněných modelů na reálná a nasimulovaná data.