

POSUDEK VEDOUcíHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Modelování velkých škod

Autor: Bc. Barbora Zuzáková

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce pojednává o modelování velkých škod v neživotnom poistení. Najskôr sú predstavené základné techniky založené na teórii extrémálnych hodnôt. Následne sa riešiteľka v práci zamerala na metódu prahov: Peaks Over Threshold. Dôležitou súčasťou práce sú spätné diagnostiky modelov a odhadov v týchto modeloch. Na záver je demonštrovaná praktická aplikácie teórie na reálne dáta.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

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

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riešiteľky práce spočíva v prehľadnom porovnaní najpoužívanějších metód na modelovanie veľkých škod v poisťovníctve a to ako po stránke matematickej i výpočetnej. Tým, že takýto prehľad je na jednom mieste, v jednotnom značení a všetky prístupy sú aplikované na spoločné dáta, táto práca môže poslúžiť ako praktický sprievodca pre modelovanie veľkých škod v neživotnom poistení.

Matematická úroveň. Práca 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 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: 18. 8. 2013