

POSUDEK VEDOUCÍHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

Název: Projekcia úmrtnostných tabuliek a ich vplyv na implicitnú hodnotu poistovne
Autor: Bc. Jakub Filka

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práca pojednáva o vývoji úmrtnostných tabuliek v Českej republike, počínajúc rokom 1950. Cieľom bolo preštudovať 6 základných modelov, ktoré môžu byť použité pre modelovanie úmrtia vo veku 60 rokov a viac. Predstavená analýza sa sústredíuje na projekčné vlastnosti modelov do najvyššieho veku.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Téma práce. Obtiažne téma bolo spracované štandardne a splňa zadanie práce.

Vlastní příspěvek. Vlastný príspevok riesiteľa práce spočíva v prehľadnom porovnaní najpoužívanejších demografických modelov pre projekciu do rokov najvyšších v súvislosti s tvorbou úmrtnostných tabuliek a ich vplyvu na implicitnú hodnotu poistovne. To najmä po stránke numerickej. Konkrétnie pre ženy, kde dáta nevykazujú takú disperziu ako u mužov, sa ukázalo, že trend úmrtnosti sa najlepšie darí zachytit logistickými modelmi, ktoré na rozdiel od Gompertz-Makehama nenahodnocujú pravdepodobnosti úmrtia vo vysokých vekoch.

Matematická úroveň. Práca je na slušnej matematickej úrovni. Častokrát sa v práci vyskytuje namiesto rovnosti len približná rovnosť, ktorá nie je rigorózne formulovaná. Očakával som i viac stochastických vlastností predstavených odhadov.

Práce se zdroji. Bibliografické zdroje v práci sú správne citované.

Formální úprava. Grafická i štýlistická úprava práce je výborná.

PŘIPOMÍNKY A OTÁZKY

Žiadne.

ZÁVĚR

Práci považuji za vynikající/velmi dobrou/průměrnou/podprůměrnou/nevhovující 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: 31. 7. 2016