

## POSUDEK VEDOUcíHO DIPLOMOVÉ PRÁCE

**Název:** Tweedie models for pricing and reserving

**Autor:** Bc. Tereza Smolárová

### SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Práce pojednává o aplikacích Tweedie modelov v procese stanovovania sadziieb poistného a tvorby technických rezerv v neživotnom poistení. 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.

**Vlastný príspevek.** Vlastný príspevok riešiteľky práce spočíva v prehľadnom predstavení Tweedie zloženého Poissonovho modelu v tarifovaní a rezervovaní. 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 reálne dáta, táto práca môže poslúžiť ako praktický sprievodca pri používaní Tweedie modelov 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: 29. 5. 2017