

Rizikově senzitivní řízení v markovských řetězcích

Studentka se ve své práci věnuje oceňování a řízení v aperiodických nerozložitelných markovských řetězcích. Řetězec je ohodnocen pomocí limity v průměru posloupnosti jistotních ekvivalentů při exponenciální užitkové funkci počítaných z průběžných výnosů řetězce. Součástí práce je iterační algoritmus vedoucí k nalezení homogenního optimálního řízení a příslušný důkaz optimality.

Téma je spíše obtížnější, přičemž je původně koncipováno jako kompilační. Oproti primárnímu zdroji práce obsahuje více rozepsanou část týkající se teorii nerozložitelných nezáporných matic a také je v práci dokázána obecná optimalita nalezeného homogenního řízení.

Studentka se snažila pracovat samostatně a odpovědně. V práci využívala nejen znalosti z teorie markovských řetězců, ale i z teorie martingalů nemluvě o Perron-Frobeniově teorii, kterou si musela nastudovat sama.

Bylo téma pro bakalářskou práci přiměřené a bylo pojato přiměřeným způsobem ?	ANO ANO
Obsahuje práce vlastní příspěvek autora ? V čem spočívá ?	ANO, viz druhý odstavec posudku
Je v práci dostatečně specifikován ?	ANO
Jaká je matematická úroveň práce ? Obsahuje práce rigorózně a korektně zformulovaný matematický text ?	OK ANO
Jsou zdroje správně citovány ?	ANO
Je po formální stránce vše v pořádku ?	ANO
Lze práci uznat jako bakalářskou ?	ANO

Na závěr lze konstatovat, že práce splňuje předpoklady kladené na bakalářskou práci na MFF UK.