

Návrh zadania bakalárskej práce

Ďalšie otázky ohľadom témy bakalárskej môžete smerovať na mňa prostredníctvom E-Mailu alebo osobne. Rada Vám ich zodpoviem.

Školiteľ: Mgr. Katarína Sternmüllerová
E-mail: katarina.sternmullerova@fmph.uniba.sk
Miestnosť: M220
Pracovisko: KAMŠ FMFI UK

Názov: **Poistné princípy založené na hodnote v riziku a podmienenej hodnote v riziku**
Premium Principles Based on the Value at Risk and the Conditional Value at Risk

Anotácia: Poistný princíp je pravidlo, na základe ktorého sa v oblasti neživotného poistenia určuje výška poistného. Hodnota v riziku a podmienená hodnota v riziku sú pojmy z teórie rizika a slúžia na ohodnocovanie miery rizika a následne na hľadanie optimálnej investičnej stratégie. Cieľom bakalárskej práce bude na základe literatúry spracovať základné vlastnosti týchto mier rizika pre spojitú náhodnú premennú a interpretovať ich z hľadiska možnej aplikácie v poisťovníctve. Súčasťou bakalárskej práce bude aj simulačná štúdia v rámci štatistického softvéru R, kde sa vykoná porovnanie poistných princípov založených na týchto mierach rizika s inými poistnými princípmi.

Cieľ práce: Určiť vlastnosti poistných princípov založených na hodnote v riziku a na podmienenej hodnote v riziku. Vykonať simulačnú štúdiu s cieľom porovnať tieto poistné princípy s inými princípmi známymi z literatúry.

Požiadavky na uchádzača o tému:

- schopnosť porozumieť anglickej odbornej literatúre,
- dobré programátorské schopnosti (v rozsahu predmetu 1-PMA-751/13 Programovanie v jazyku R),
- téma bakalárskej práce je primárne určená pre študenta programu Poistná matematika prípadne Matematika (so zameraním na Pravdepodobnosť a matematickú štatistiku).