

Vorlesungsankündigung für das WiSe 2010/11

Schadenversicherungsmathematik

TV 4 Mo 12 – 14 Uhr F 107
Mi 08 – 10 Uhr F 303
TU 2 Do 10 – 12 Uhr F 442 (Die Übung wird von T. Böhme betreut.)

Inhalt:

Die Vorlesung bietet eine Einführung in die Schadenversicherungsmathematik und umfasst folgende Themenbereiche:

- Gesamtschaden im individuellen und kollektiven Modell
- Ruintheorie
- Prämienkalkulationsprinzipien und Vertrauenstarifizierung
- Reservierung für Spätschäden
- Risikoteilung und Rückversicherung

Die Deutsche Aktuarvereinigung (DAV) erkennt bestandene Klausuren als Prüfungsleistung für das Fach *Schadenversicherungsmathematik* an. Eine Vorlesung zur Personenversicherungsmathematik wird im SoSe 2011 angeboten.

Vorkenntnisse:

Der Besuch dieser Vorlesung setzt gute Grundkenntnisse im Bereich der Stochastik voraus. Die Vorlesung Stochastik II kann bei Bedarf auch parallel gehört werden. Außerdem wird die Teilnahme an der Vorlesung Finanzmathematik I empfohlen.

Literatur:

- T. Mack (2002): Schadenversicherungsmathematik.VVW, Karlsruhe.
- T. Mikosch (2004): Non-Life Insurance Mathematics. Springer, Berlin.
- K. D. Schmidt (2005): Versicherungsmathematik. Springer, Berlin.
- H. Schmidli: Lecture Notes on Risk Theory.
<http://www.math.ku.dk/~schmidli/rt.pdf>

Weitere Literaturempfehlungen werden zu Beginn der Vorlesung gegeben.