

Vorlesungsankündigung für das Sommersemester 2010

Personenversicherungsmathematik

Inhalt:

Einführung in die Personenversicherungsmathematik

1. Ein allgemeines Lebensversicherungsmodell
2. Verzinsung
3. Zahlungsströme und Deckungskapital
4. Differenzen- und Differentialgleichungen
5. Hattendorfsches Theorem
6. Fondgebundene Policen
7. Versicherungen mit stochastischem Zins
8. Technische Analyse
9. Marktkonsistente Bewertung

Literatur:

Koller, M., *Stochastische Modelle in der Lebensversicherung*, Springer, 2000.

Vorkenntnisse:

Die Teilnahme an der Vorlesung setzt gute Grundkenntnisse im Bereich der Stochastik, etwa im Umfang der Vorlesungen Stochastik I und Stochastik II, voraus.

Zeit und Ort:

Vorlesung: Mi 14 – 16, f 102; Fr 14 – 16, a 310. Übung: Mo 10 – 12, f 342

Kontakt:

- Prof. Dr. Stefan Weber, sweber@stochastik.uni-hannover.de,
Sprechstunde nach Vereinbarung
- Timo Hirscher, hirscher@stochastik.uni-hannover.de, Sprechstunde nach Vereinbarung
- Sekretariat:
Sylvia Voss, svoss@stochastik.uni-hannover.de, Tel.: 762-4250
Sprechstunde: Mo – Fr 10 – 12, Hauptgebäude f 439