

Vorlesungsankündigung für das SoSe 2011

Personenversicherungsmathematik

TV 2 Mo 16 – 18 Uhr F 442
TU 2 Di 16 – 18 Uhr F 442

Inhalt:

- Produkte der Personenversicherung
- Zins und Kostenzuschläge als Rechnungsgrundlagen
- Sterbe- und Überlebenswahrscheinlichkeiten, Sterbetafeln
- Barwerte von Leistungen
- Äquivalenzprinzip und Prämienberechnung
- Deckungsrückstellungen
- Überschussbeteiligung
- Marktkonsistente Bewertung

Vorkenntnisse:

Die Vorlesung basiert auf dem Lehrstoff der Vorlesung Stochastik I. Weiterführende probabilistische Konzepte und Techniken werden nach Bedarf in der Vorlesung entwickelt.

Literatur:

- Gerber, H. U.: *Lebensversicherungsmathematik*, Springer, 1998.
- Koller, M.: *Stochastische Modelle in der Lebensversicherung*, Springer, 2010.
- Milbrodt, H., Helbig, M.: *Mathematische Methoden der Personenversicherung*, de Gruyter, 1999.
- Wolfsdorf, K.: *Versicherungsmathematik, Teil 1: Personenversicherung*, Teubner, 1997.

Weitere Literaturempfehlungen werden zu Beginn der Vorlesung gegeben.