

Vorlesungsankündigung für das WiSe 2012/13

Personenversicherungsmathematik

Die Veranstaltung besteht aus einer Vorlesung zur Lebensversicherungsmathematik mit Übung sowie einem Blockkurs zur Pensions- und Krankenversicherungsmathematik.

TV 2	Mo	14 – 16 Uhr	F 428
TU 2	Do	16 – 18 Uhr	F 142
Blockkurs	14.03.-16.03.2013	09 – 18 Uhr	F 428

Inhalt:

- *Lebensversicherungsmathematik:*
Produkte, Rechnungsgrundlagen (Biometrie, Zins, Kosten), Herleitung und Anwendung von Sterbetafeln, Erfüllungsbetrag und Leistungsbarwerte, Äquivalenzprinzip, Prämienberechnung, Deckungsrückstellungen, Thiele'sche Differentialgleichung, Überschussbeteiligung, marktkonsistente Bewertung
- *Pensionsversicherungsmathematik:*
Umfeld und Inhalt von Pensionszusagen, Zustandsdiagramme, Axiomensystem von Neuburger, Bestandsmodelle, zusammengesetzte Ausscheidereordnungen, Schätzung von Ausscheidewahrscheinlichkeiten, Erfüllungsbetrag und Leistungsbarwerte, Prämien, Reserven, internationale Rechnungslegung
- *Krankenversicherungsmathematik:*
ökonomisches und rechtliches Umfeld, Tarifarten, Beitragsberechnung für das Neugeschäft, Alterungsrückstellung und Übertragungswert, Tarifwechsel, Überschussbeteiligung zur Beitragsermäßigung im Alter, aktuarieller Kontrollzyklus, aktuarielle Methoden zur Quantifizierung des Risikos

Vorkenntnisse:

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

Aktuarausbildung:

Die Deutsche Aktuarvereinigung (DAV) erkennt eine bestandene Klausur über die Inhalte der drei Lernmodule Lebens-, Pensions- und Krankenversicherungsmathematik als Prüfungsleistung für das Fach Personenversicherungsmathematik an.

Literatur:

- Gerber, H. U.: *Lebensversicherungsmathematik*, Springer, 1998.
- Milbrodt, H., Helbig, M.: *Mathematische Methoden der Personenversicherung*, de Gruyter, 1999.
- Neuburger, E. (Ed.): *Mathematik und Technik betrieblicher Pensionszusagen*, Schriftenreihe Angewandte Pensionsversicherungsmathematik, Heft 25, 1997.
- Neuburger, E.: *Skript zur Pensionsversicherungsmathematik*, www.neuburger.com.
- Milbrodt, H.: *Aktuarielle Methoden der deutschen Privaten Krankenversicherung*, Schriftenreihe Angewandte Versicherungsmathematik, Heft 34, Verlag Versicherungswirtschaft, 2005.

Weitere Literaturempfehlungen werden zu Beginn der Veranstaltungen gegeben. Zudem werden ein Skript sowie Foliensätze zur Verfügung gestellt.