

Vorlesungsankündigung für das WiSe 2012/13

Risikothorie

TV 2 Mi 16 – 18 Uhr G 123
TU 1 Mi 18 – 19 Uhr G 123

Inhalt:

Die Vorlesung bietet eine Einführung in die Risikothorie und umfaßt folgende Themenbereiche:

- Risikomaße
- Copulae
- Monte-Carlo-Methoden
- Punktschätzung
- Hypothesentests
- Verallgemeinerte Lineare Modelle
- Credibility
- Biometrische Rechnungsgrundlagen

Vorkenntnisse:

Der Besuch dieser Vorlesung setzt gute Grundkenntnisse im Bereich der Stochastik, etwa im Umfang der Vorlesungen Stochastik I&II, voraus. Die Vorlesung Stochastik II kann bei Bedarf auch parallel gehört werden.

Literaturempfehlungen zur Vorlesung:

Bühlmann und Gisler [2005]: *A Course in Credibility Theory and its Applications*, Springer.

Heilmann [1987]: *Grundbegriffe der Risikothorie*, VVW.

Lehmann und Casella [1998]: *Theory of Point Estimation*, Springer.

Meyers, Montgomery, Vining [1999]: *General Linear Models*, Wiley.

Nelsen [1999]: *An Introduction to Copulas*, Springer.

Weitere Literaturempfehlungen werden zu Beginn der Vorlesung gegeben.