

Vorlesungsankündigung für das WiSe 2011/12

Schadenversicherungsmathematik

TV 4	Mo	16.00 – 17.30 Uhr	F 442
	Di	16.00 – 17.30 Uhr	B 302
TU 2	Di	17.40 – 19.10 Uhr	F 428

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 2012 angeboten.

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.

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.