VORLESUNG FINANZ- und VERSICHERUNGSMATHEMATIK I

H.-J. Bartels

Termin: **Mo. 10.15 Uhr – 11.45 Uhr**
Mi. 10.15 Uhr - 11.45 Uhr

Vorlesungsbeginn: 9.2.2015

Hörsaal: C**013**

Übungen zur Vorlesung: Mo. 12.00 -13.30 Uhr, C013

Der Stoff der Vorlesung wendet sich an Studenten der Mathematik mittlerer Semester mit Interesse an Fragen der Wirtschafts- und Finanzmathematik. Kenntnisse in Stochastik sind erwünscht, wenngleich zu Beginn der Vorlesung wenig an speziellen Vorkenntnissen benötigt wird. Zum Inhalt der Vorlesung:
Neben den klassischen Grundlagen der Finanz- und Lebensversicherungsmathematik
(u.a. Berechnung von Prämien und Deckungsrückstellungen mit Hilfe von Kommutationswerten)
werden Grundlagen der individuellen und der kollektiven Risikotheorie behandelt. Die exakte bzw. approximative Berechnung von Gesamtschadenverteilungen wird dann auf Fragen der Rückversicherung angewendet (u.a. Berechnung von Selbstbehalten bei Summenexzedenten Verträgen, Stop-Loss-Kontrakte als Pareto-optimale Rückversicherungsverträge).

Literatur zur Vorlesung:

1.) Hans U. Gerber : Life Insurance Mathematics, 2nd edition, 1995, Springer Verlag Heidelberg
2.) Hans U. Gerber: An Introduction to Mathematical Risk Theory, 1979, Huebner Foundation for Insurance education University of Pennsylvania, Philadelphia

Weitere Literatur wird in der Vorlesung genannt.