

Teoria Ruiny

W semestrze letnim 2012 będę prowadził wykład monograficzny według nowej monografii

Assmusena i Albrachera „*Ruin theory*” (World Scientific, 2010).

Zaczniemy od rozdziału 2-go: Martingales and simple ruin calculations, potem rozdz. 3-ci i 4-ty o klasycznym modelu złożonego Poissona. Planuję też przerobić rozdziały dotyczące teorii ruiny dla procesów Levy'ego.

Wykład i ćwiczenia odbywają się w czwartki od godziny 15-tej w sali 602.

Tomasz Rolski