

Wykład: Ubezpieczenia na życie II.

Tomasz Rolski

1. Wstęp; zarys historyczny.
2. Elementy matematyki finansowej.
3. Elementy analizy przeżycia (survival analysis).
4. Podstawowe pojęcia teorii ubezpieczeń życiowych: strata, rezerwa, wariancja straty.
Równanie różniczkowe Thiele'go,
twierdzenie Hattendorfa.
5. Ubezpieczenia na życie jednej osoby; jednoopcyjne i wieloopcyjne.
6. Ubezpieczenia na życie kilku osób.
7. Ubezpieczenia z funduszem; equity linked insurance.
8. Ubezpieczenia wielostanowe; modelowanie przy użyciu procesu stochastycznego.
9. Współczesne problemy w prognozowaniu przyszłego czasu życia.

Pełna bibliografia, szczególnie do prac, będzie podana na wykładzie.

Literatura

- [1] Błaszczyszyn, B. & Rolski, T. (2004) *Podstawy Matematyki Ubezpieczeń na Życie*, WNT.
- [2] Bowers, N.L., Gerber, H.U., Hickman, J.C. & Nesbitt, C.J.
Actuarial Mathematics,
The Society of Actuaries.
- [3] R. Norberg (2002) Basic life insurance mathematics. Skrypt, Kopenhaga.