

VERSICHERUNGSMATHEMATIK

	Büro	e-mail	Sprechstunde
Dozent:	Dr. Marcel Ortgiese	MA 769 ortgiese@math.tu-berlin.de	Do 9-11
Assistent:	Simon Wasserroth	MA 785 wasserroth@math.tu-berlin.de	Di 16:00-17:30

Termine

Vorlesung:	Montag	12 - 14	MA 004
	Freitag	10 - 12	H 0111
Übung:	Donnerstag	14 - 16	BH 333

Die erste Übung findet in der zweiten Woche statt.

Aufgaben

Die Aufgabenblätter können auf der homepage gefunden werden und sollen in Gruppen zu dritt vor(!) der Übung abgegeben werden. Um den Schein zu erhalten, benötigt man 50% der erreichbaren Punkte.

Voraussetzungen Wahrscheinlichkeitstheorie 1, ein paralleler Besuch von Wahrscheinlichkeitstheorie 2 wird empfohlen.

Literatur Die Vorlesung orientiert sich in weiten Teilen an dem folgenden Skript: J. Blath, Skript Versicherungsmathematik Eine Kopiervorlage wird im Sekretariat MA 7-5, MA 747 bei Frau Willmers zur Verfügung gestellt.

Weitere Literaturvorschläge

- allgemeine Versicherungsmathematik: [Sch09].
- Lebensversicherungsmathematik: [MH99] und [Kol10].
- Ruintheorie und Extremwerte: [EKM97]

Homepage

<http://www3.math.tu-berlin.de/Vorlesungen/WS11/Versicherungsmathe/>

Literatur

[EKM97] P. Embrechts, C. Klüppelberg, and T. Mikosch. *Modelling extremal events*, volume 33 of *Applications of Mathematics (New York)*. Springer-Verlag, Berlin, 1997. For insurance and finance.

- [Kol10] M. Koller. *Stochastische Modelle in der Lebensversicherung*. Springer, Berlin, 2010.
- [MH99] H. Milbrodt and M. Helbig. *Mathematische Methoden der Personenversicherung*. Walter de Gruyter, Berlin, 1999.
- [Sch09] K. D. Schmidt. *Versicherungsmathematik*. Springer, Berlin, 2009.