

Informationsblatt zur Vorlesung Versicherungsmathematik

1. Termine:

Vorlesung:	Di	14:15 - 15:45 Uhr	MA 005	Beginn: 14.10.2008
	Mi	12:15 - 13:45 Uhr	BH 0348	
Übung:	Do	12:15 - 13:45 Uhr	MA 749	Beginn: 16.10.2008

2. Sprechstunden:

Prof. Dr. Michael Scheutzow	Di	10:00 - 11:30	MA 776
Stephan Sturm	Mo	15:00 - 16:30	MA 780
Sekretariat: Maria Willmers	Mo, Di, Do, Fr	09:30 - 11:30 Uhr	MA 747

- Homepage:** Informationen zu Vorlesung und Übungsaufgaben sind unter <http://www.math.tu-berlin.de/~ststurm/vm/vm.html> verfügbar.
- Inhalt:** Lebens- und Sachversicherungsmathematik
- Voraussetzungen:** Wahrscheinlichkeitstheorie I; ein (paralleler) Besuch der Vorlesung Wahrscheinlichkeitstheorie II wird empfohlen
- Scheinkriterien:** 50% der erreichbaren Hausaufgabenpunkte und aktive Mitarbeit in den Übungen.
- Modulprüfung** (für Bachelor-Studierende): Die Modulprüfung findet als mündliche Prüfung statt (bei sehr großem Andrang kann sie durch eine Klausur am Semesterende ersetzt werden). Zulassungsvoraussetzung ist der Erwerb des Übungsscheines.
- Übungsaufgaben** werden Donnerstag in der Übung ausgegeben und sind spätestens Donnerstag der folgenden Woche vor der Übung abzugeben. Alternativ können die Aufgaben auch von der Homepage heruntergeladen werden. Die Aufgaben sollten in Gruppen (von bis zu 3 Personen) bearbeitet werden.

9. 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.

a) Maß- und Wahrscheinlichkeitstheorie

- P. Billingsley, *Probability and Measure*, New York (Wiley) ³1995
- R. Durrett, *Probability: Theory and Examples*, Belmont (Duxbury Press) ³2004
- J. Elstrodt, *Maß- und Integrationstheorie*, Berlin(Springer) ⁵2007
- W. Feller, *An Introduction to Probability Theory and its Applications*, New York (Wiley) 1950/1966
- J. Gärtner, *Maßtheorie*, Vorlesungsskript:
http://www.math.tu-berlin.de/stoch/HOME/PAGES/van_barg/M&ISS08/mit.pdf

b) Lebensversicherungsmathematik

- H. Gerber, *Lebensversicherungsmathematik*, Berlin (Springer) 1986
- H. Milbrodt und M. Helbig, *Mathematische Methoden der Personenversicherung*, Berlin (de Gruyter) 1999
- K. Schmidt, *Versicherungsmathematik*, Berlin (Springer) 2002

c) Sachversicherungsmathematik

- H. Drees, *Risikotheorie*, Vorlesungsskript:
http://www.math.uni-hamburg.de/home/drees/VM2_05/VM%20II%20SS%2005.pdf
- P. Embrechts, C. Klüppelberg und T. Mikosch, *Modelling Extremal Events for Insurance and Finance*, Berlin (Springer) 1997
- T. Mikosch, *Non-Life Insurance Mathematics*, Berlin (Springer) 2004
- M. Riedel, *Skript zu Risikotheorie*,
http://www.math.uni-leipzig.de/~riedel/risiko2/risikoskript_2005.pdf
- M. Riedle, *Script zu Risikotheorie*,
<http://www.mathematik.hu-berlin.de/~riedle/research/scriptrisiko.pdf>
- E. Straub, *Non-Life Insurance Mathematics*, Berlin (Springer) ²1997