

# Insurance Risk Models (Модели страховых рисков)

(актуарная группа; на английском языке)

полугодовой спец. курс для студентов 3-5 курсов

Lecturer: Professor Gennady Falin (лектор: д.ф.м.н., проф. Г.И.Фалин)

## Reading List (Литература)

### Core Texts

1. Harry H.Panjer, Gordon E.Willmot. Insurance Risk Models. The Society of Actuaries, 1992. ISBN 0-938959-25-5

2. N.L. Bowers, et al. *Actuarial Mathematics*. The Society of Actuaries, 1986. (есть русский перевод второго издания: Н.Бауэрс, Х.Гербер, Д.Джонс, С.Несбитт, Дж.Хикман. *Актуарная математика*. Перев. с англ. М.: Янус, 2001. ISBN 5-8037-0065-7)

3. Hans U.Gerber. *An Introduction to Mathematical Risk Theory*. Wharton School, University of Pennsylvania, 1979. ISBN 0-918930-08-1 (гл.5, стр. 66-81)

5. Mary R. Hardy. An introduction to risk measures for actuarial applications. Education and Examination Committee of the Society of Actuaries, 2006.

6. Robert V.Hogg, Stuart A.Klugman. Loss Distributions. John Wiley & Sons, 1984. ISBN 0-471-87929-0

7. I.B.Hossack, J.H.Pollard, B.Zehnwirth. Introductory Statistics with Applications in General Insurance. Cambridge University Press, 1989. ISBN 0-521-28957-2/ 0-521-24781-0

### Recommended Reading

1. Г.И.Фалин. *Математический анализ рисков в страховании*, Российский юридический издательский дом, Москва, 1994. ISBN 5-88635-003-0

2. Г.И.Фалин, А.И.Фалин. *Теория риска для актуариев в задачах*, 2-е издание: Мир, Москва, 2004. 240 с., ил. ISBN 5-03-003607-5