

д.ф.-м.н., профессор Г.И.Фалин
Дополнительные главы актуарной математики
(полугодовой спецкурс)
Аннотация

Цель курса -- ознакомить студентов, изучающих основы математики страхования жизни, с методом тестирования прибыли, который является одним из самых важных методов актуарных расчётов. В связи с этим кратко изложены простейшие методы тарификации (принцип эквивалентности обязательств, персентильная премия) и основы теории страховых резервов. Теория иллюстрируется с помощью подробного решения специально подобранных задач, которые предлагались в последние годы на квалификационных актуарных экзаменах Института и Факультета Актуариев (The Institute and Faculty of Actuaries, Великобритания), Общества Актуариев (The Society of Actuaries, США), Банка России. На примере этих задач показано, как использовать для актуарных расчётов Microsoft Excel.

Курс ориентирован на студентов экономико-математических специальностей, интересующихся актуарной математикой, страхованием, финансовыми расчётами. Он также будет полезен актуариям, которые захотят повысить свой профессиональный уровень и получить общепризнанную актуарную квалификацию.