

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

Тема 1	Основы страхового законодательства и регулирования
Тема 2	Принцип эквивалентности обязательств. Персентильная премия. Недостатки.
Тема 3	Регулирование тарификации страхования жизни и метод тестирования прибыли
Тема 4	Актуарная модель договора страхования. Денежные потоки. Актуарные предположения (тарифный базис)
Тема 5	Средняя прибыль страховщика за один страховой год без учёта резервов. Вектор дохода. Характеристика дохода. Модификация на случай непрерывных договоров
Тема 6	Меры доходности договора страхования для страховщика (внутренняя ставка дохода, чистая текущая стоимость, маржа прибыли, период окупаемости, дисконтированный период окупаемости).
Тема 7	Расчёт премий на основе принципа эквивалентности обязательств методом тестирования прибыли
Тема 8	Страховой резерв (ценность договора). Определение. Терминология. Резервы для общего дискретного договора
Тема 9	Рекуррентная формула для резервов. Интерпретация.
Тема 10	Промежуточный резерв. Предположение Балдуччи.
Тема 11	Ретроспективная формула для резервов. Актуарное накопление. Актуарный коэффициент дисконтирования
Тема 12	Задачи актуарных квалификационных экзаменов по теме «резервы»
Тема 13	Метод тестирования прибыли при учёте резервов
Тема 14	Задачи актуарных квалификационных экзаменов.
Тема 15	Доход как случайная величина
Тема 16	Теорема Хаттендорфа