

ОПИС ПРЕДМЕТА КУРСУ
Предмет: АКТУАРНІ РОЗРАХУНКИ
Лектор: Мороз Катерина Вікторівна
Факультет: економічний

Курс 6

Обов'язковий:
Вибірковий: X
Семестр: 11

Загальна кількість годин: 108
Лекції, годин: – 8;
Лабораторні – 6;
Практичні заняття, годин: – 4

КОД:

ECTS 3 кредити

МЕТА: формування системи фундаментальних знань щодо сутності, побудови та аналізу математичних моделей і методів, що регламентують відносини між страховиками і страхувальниками.

ПРОГРАМА: Часова вартість грошей. Приведена вартість. Оцінювання серії платежів. Оцінювання доходності інвестиційних проектів. Характеристики тривалості життя. Функція виживаності. Крива смертей. Аналітичні закони смертності. Залишковий час життя. Короткострокове страхування життя: побудова тарифних ставок, розрахунок нетто-премій, захисна надбавка. Найпростіша модель функціонування страхової компанії. Довгострокове страхування життя. Основні види довгострокового страхування життя. Актуарна сучасна вартість зобов'язань. Довічні ренти. Основні види рент. Оцінювання сучасної вартості довічної, тимчасової довічної та відстроченої довічної рент. Актуарне накопичення. Періодичні премії. Розрахунок резервів страхової компанії.

БІБЛІОГРАФІЯ:

1. Фалин Г.И., Фалин А.И. Актуарная математика в задачах. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: ФИЗМАТЛИТ, 2003. – 192 с.
2. Кларк С.М. и др. Основы актуарной математики. – М.: «Общество актуариев», 2000. (пер. с англ. учебного пособия Institute and Faculty of Actuaries: Новиков В.В. и Селиванова Д.О.).
3. Оленко А.Я. Збірник задач з актуарної математики. –К.: ВПЦ "Київський університет", 2005.
4. . Бауэрс, Х. Гербер, Д. Джонс, С. Несбитт, Дж. Хикман. Актуарная математика / Перевод с английского под редакцией В.К. Малиновского - М.: "Янус-К", 2001. - 644 с..
5. Гербер Х. Математика страхования жизни. — М.: Мир. — 1994.
6. Хэберман С., Лафрум Г., Рейлли Д. (1996) Основы актуарной математики, модули 1, 2. – Кемерово (пер. с англ. учебного пособия Institute and Faculty of Actuaries).
7. С.Е. Савич. Элементарная теория страхования жизни и трудоспособности. Изд.-3-е, исправленное, с дополнениями М.: Янус-К, 2003. 496 с.

МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ:

Модульний контрольний тест	20%
Індивідуальне розрахункове завдання	40%
Залік	40%

ПЕРЕДУМОВИ: студенти мають володіти знаннями з курсу «Математичний аналіз», «Теорія ймовірностей».

ІНДИВІДУАЛЬНА РОБОТА: передбачене індивідуальне розрахункове завдання «Актуарні розрахунки в моделях страхування життя»