

Aktuar riyaziyyatın əsasları fənni üzrə

PROQRAM

(Ehtimal nəzəriyyəsi və riyazi statistika ixtisası)

(30 saat müəhazirə, 15 saat məşğələ)

Tərtibçi: riyaziyyat elmləri doktoru, dos. Rövşən Əliyev

Aktuar riyaziyyatının predmeti və ilkin anlayışları (sığorta haqqı və sığorta məbləği. Sığorta riski və sığorta hadisəsi).

1. Yaşama müddəti və yaşam funksiyası.
2. Ölüm əyriləri. Ömür müddətinin əsas ehtimal xarakteristikası.
3. Qalan ömür müddətinin ehtimal xarakteristikaları.
4. Ölümlülüyün analitik qanunları.
5. Arqumentin tam olmayan qiymətlərində yaşam funksiyası üçün yaxınlaşmalar. Balduççi təklifi.
6. Tam olmayan yaşlar üçün ömür müddətinin paylanması üçün integral xarakteristikaları.
7. Qısamüddətli ömür sığortası modellərinin analizi.
8. Yuvarlaqlaşdırılmış ömür müddətinin paylanması və xarakteristikaları.
9. İndividual risk modeli. Sığorta ödəmələrinin təyin olunması prinsipləri.
10. Kollektiv risk modeli.
11. Dinamik iflas modeli. İflas ehtimalı üçün Lundberq bərabərsizliyi.
12. Klassik risk prosesində iflas ehtimalı üçün Pollaçek-Xinçin-Beekman düsturu.
13. Sparre Andersen modeli. İflas ehtimalının asimptotik davranışı: Kramer-Lundberq teoremi.
14. Gerber-Shu funksiyası və onun müasir sığorta nəzəriyyəsindəki rolu.
15. Təkrar sığorta modelləri.

Ədəbiyyat

1. Булинская Е.В. Теория риска и перестрахование, часть 1, М.: МГУ, 2001.
2. Кошкин Г.М. Основы страховой математики: Учебное пособие /Томск: Томский государственный университет, 2002, 116 с.
3. Фалин Г.И. Математический анализ рисков в страховании. М.: Российский юридический издательский дом, 1994, 130 с.
4. Фалин Г.И., Фалин А.И. Актуарная математика в задачах. 2-е изд., перераб. и доп. М.: ФИЗМАТЛИТ, 2003, 192 с.
5. Фалин Г.И., Фалин А.И. Введение в актуарную математику. М.: Изд-во МГУ, 1994, 86 с.
6. Asmussen S. Ruin Probabilities. World Scientific, 2000, 620 p.
7. Dickson D. Insurance risk and ruin. Cambridge University Press, 1996, 227 p.

