

ДИСЦИПЛІНА «РИЗИКИ І ОПТИМІЗАЦІЯ В АКТУАРНІЙ МАТЕМАТИЦІ»

Анотація. Дисципліна «Ризики і оптимізація в актуарній математиці» належить до вибірових компонент освітньої програми, блоку дисциплін вільного вибору аспіранта. Вона забезпечує професійний розвиток, спрямована на формування концептуальних та методологічних знань у галузі математики і статистики, вміння критично аналізувати, оцінювати і синтезувати нові та комплексні ідеї, аналізувати наукові праці, формулювати методологічну базу власного наукового дослідження, здатність формулювати наукову проблему, робочі гіпотези досліджуваної проблеми. В рамках дисципліни вивчаються основні принципи та методи актуарного ризик-менеджменту та оптимізації, зокрема математичні моделі для обчислення справедливої величини страхових премій, обсягу нормативних резервів, величини капіталу, необхідного для забезпечення встановленого рівня стійкості та надійності страхової компанії.

Мета навчальної дисципліни: дати сучасні знання про можливість використання математичних моделей у професійній діяльності страхових компаній.

Попередні вимоги: Аспірант повинен знати: основні методи ризик-менеджменту та оптимізації в актуарній математиці, основні поняття теорії ймовірностей та математичної статистики, теорії випадкових процесів

Змістовні модулі:

- Основні означення, поняття та математичні моделі страхування життя;
- Основні означення, поняття та математичні моделі ризикового страхування;
- Математичні моделі страхування життя;
- Ризики і оптимізація.

Мова викладання: українська

Рік підготовки, шифр навчальної дисципліни: друге півріччя другого року навчання

Кількість кредитів: 4

Форма заключного контролю: іспит

Структура навчальної дисципліни: загальний обсяг 120 годин, у тому числі 24 години аудиторних занять (18 год. – лекційні заняття, 4 год. – практичні заняття, 2 години – консультація), 96 годин самостійної роботи.

Викладач: Зубченко Володимир Петрович, к.ф.-м.н., асистент кафедри теорії ймовірностей, статистики та актуарної математики механіко-математичного факультету.

Інформація про викладача:

<https://probability.knu.ua/index.php?page=userinfo&person=zubchenko>