

Оглавление

Глава 1. Введение	5
§ 1.1. Что такое математика страхования?	5
§ 1.2. История актуарной математики	8
§ 1.3. Определение свободной профессии	10
§ 1.4. Разрешение конфликта между корпоративной и публичной ответственностью	11
§ 1.5. Как пользоваться этой книгой	12
Глава 2. Основы актуарной математики	14
§ 2.1. Обобщенный финансовый поток	14
§ 2.2. Введение в доходность (yields)	22
§ 2.3. Упорядочение рисков	23
§ 2.4. Принципы формирования премии	42
§ 2.5. Теория полезности	49
§ 2.6. Элементы финансовой математики	56
§ 2.7. NP-приближение	70
Глава 3. Страхование жизни	72
§ 3.1. Задачи по страхованию жизни и общему страхованию	72
§ 3.2. Актуарные вычисления: одна жизнь	96
§ 3.3. Актуарные модели с двумя жизнями	110
Глава 4. Актуарная статистика	121
§ 4.1. Автострахование	121
§ 4.2. Портфель страхования	129
§ 4.3. Страхование и перестрахование	145
§ 4.4. Элементы теории игр	163
§ 4.5. Временные ряды	171
§ 4.6. Теория доверия (credibility theory)	174
Глава 5. Теория разорения	206
§ 5.1. Элементарная теория разорения	206
§ 5.2. Процессы Леви	242
§ 5.3. Распределения фазового типа (PH)	267

§ 5.4. Процессы восстановления и субординаторы	293
§ 5.5. Аналитические средства	331
§ 5.6. Задачи по теории разорения и процессам Леви	346
§ 5.7. Равномерная асимптотика вероятностей разорения для процессов Леви	361
 Глава 6. Дополнительные задачи	 373
§ 6.1. Оптимизация	373
§ 6.2. Стохастический анализ	388
 Формулы и таблицы для экзаменов, проводящихся Факультетом и Институтом Актуариев	 412
Литература	472