

Vorlesung (2+1)
Stochastische Modelle
der Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Noemi Kurt

Wintersemester 2025/26

Vorlesung: Freitag 10-12 Uhr, RM10, 903, Beginn in der 2. Semesterwoche

Übung: Mittwoch 10-12, RM10, 711 groß, Beginn in der 3. Semesterwoche

Veranstaltung: Wahlpflichtmodul, BaM-STO, MaM-STO, 5 CP

Voraussetzungen: Elementare Stochastik. Hilfreich: Stochastische Prozesse.

Inhalt: In dieser Vorlesung behandeln wir klassische stochastische Modelle der Versicherungsmathematik, insbesondere der Schadensversicherungsmathematik. Themen: Statische Risikomodelle, Gesamtschadenverteilung, Dynamische Risikomodelle und Ruintheorie, Lundberg-Bedingungen, subexponentielle Verteilungen, Risikomaße.

Literatur: Die Vorlesung folgt ausgewählten Kapiteln des Buches **Jochen Blath, Marcel Ortgiese, Michael Scheutzow: Stochastische Modelle der Versicherungsmathematik, erscheint 2025.**

Kontakt: Prof. Dr. Noemi Kurt, kurt@math.uni-frankfurt.de .