

Sylabus pro předmět

ACTUARIAL RISK MODELING

Kód předmětu:	4ITCZV003
Název v jazyce výuky:	Actuarial risk modeling
Název česky:	Actuarial risk modeling
Název anglicky:	Actuarial risk modeling
Počet přidělených ECTS kreditů:	3
Forma výuky kurzu:	žádná
Forma ukončení kurzu:	zkouška
Jazyk výuky:	angličtina
Doporučený typ a ročník studia:	— obsah této položky nebyl definován —
Semestr:	ZS 2023/2024
Vyučující:	Ing. Pavel Zimmermann, Ph.D. (garant)
Omezení pro zápis:	žádné
Doporučené doplňky kurzu:	žádné
Vyžadovaná praxe:	žádná

Zaměření předmětu:

Předmět je zaměřen na poskytnutí znalosti a dovednosti v oblasti modelování pojistně matematických rizik. Studenti se naučí identifikovat, měřit a řídit rizika v pojišťovacím sektoru pomocí různých statistických, matematických a pravděpodobnostních modelů. Důraz je kladen na aplikaci těchto modelů v praxi a na jejich využití při strategickém rozhodování. Obsah předmětu je vytvořen na základě sylabu Evropské aktuárské asociace (CORE SYLLABUS FOR ACTUARIAL TRAINING IN EUROPE)

Výsledky učení:

Po absolvování předmětu by studenti měli dosáhnout následujících výsledků:

Studenti budou mít základní a pokročilou znalost o aktuárských rizicích, včetně jejich charakteristik, příčin, měření a řízení.

Studenti budou schopni identifikovat a modelovat různé typy rizik v pojistném sektoru pomocí statistických, matematických a pravděpodobnostních metod.

Studenti budou schopni hodnotit a měřit riziko.

Studenti budou schopni aplikovat naučené aktuárské modely na konkrétní situace v pojišťovacím sektoru a interpretovat výsledky pro podporu rozhodování.

Obsah předmětu:

Regulace solventnosti
Riziko rezerv
Riziko pojistného
Riziko životního pojištění
Riziko zdravotního pojištění
Interní modely

Způsob studia, metody výuky a studijní zátěž (počet hodin):

Druh	Počet hodin studijní zátěže
	Prezenční studium
Příprava na závěrečný test	39
Příprava na závěrečnou ústní zkoušku	39
Celkem	78

Způsoby a kritéria hodnocení:

Druh	Váha
	Prezenční studium
Absolvování závěrečného testu	50 %
Absolvování závěrečné ústní zkoušky	50 %
Celkem	100 %

Hodnocení:

Zkoušky

1 Výborně (90 – 100 %)

2 Velmi dobře (75 – 89 %)

3 Dobře (60 – 74 %)

4 Nedostatečně (0 – 59 %)

Zápočty

Z Započteno

NZ Nezapočteno

Zvláštní podmínky a podrobnosti:

žádné

Literatura:

Typ*	Autor	Název	Místo vydání	Nakladatel	Rok	ISBN
D	IOA, Alessandro Carrato MSc FIA, and Gráinne McGuire PhD FIAA.	"A Practitioner's Introduction to Stochastic Reserving."	(2016).			
D	Shapland, Mark R., and Jessica Leong.	"Bootstrap modeling: beyond the basics. Casualty Actuarial Society E-Forum, Fall 2010.	2010.			
D	Wuthrich, Mario V.,	Non-Life Insurance: Mathematics & Statistics. https://dx.doi.org/10.2139/ssrn.2319328				

* Z – základní literatura D – doporučená literatura



Financováno
Evropskou unií
NextGenerationEU



Národní
plán
obnovy



MINISTERSTVO ŠKOLSTVÍ,
MLÁDEŽE A TĚLOVÝCHOVY