

## Literatura do egzaminu „Zarządzanie ryzykiem zakładu ubezpieczeń”

Data publikacji: 02.03.2022

Obowiązuje do egzaminów organizowanych po dn. 02.06.2022

1. Egzamin wykorzystuje wiedzę z egzaminów 1, 2, 3, 4 i 7 (numeracja egzaminów zgodna z Rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 9 grudnia 2016 r. w sprawie egzaminu aktuarialnego (Dz.U. z 2016 r. poz. 2182)).
2. DYREKTYWA PARLAMENTU EUROPEJSKIEGO I RADY 2009/138/WE z dnia 25 listopada 2009 r. w sprawie podejmowania i prowadzenia działalności ubezpieczeniowej i reasekuracyjnej (Wypłacalność II):
  - Art. 13, 41-48, 75-85, 87-91, 100-110, 112-126, 128-129.
3. ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2015/35 z dnia 10 października 2014 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/138/WE w sprawie podejmowania i prowadzenia działalności ubezpieczeniowej i reasekuracyjnej (Wypłacalność II):
  - Art. 7-10, 12, 15, 17-40, 43-47, 55 (Załącznik 1), 83, 87, 113-143, 164-173, 175-181, 203-207, 218-220 (Załącznik XVII), 222-253, 258-272.
4. Claims run-off uncertainty: the full picture, 2015, Michael Merz, Mario Wüthrich, [https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=2524352](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=2524352).
5. Financial Enterprise Risk Management, 2<sup>nd</sup> edition, 2017, Paul Sweeting:
  - Rozdziały 1, 6-7, 14-18.
6. Actuarial Finance – Derivatives, Quantitative Models and Risk Management, 2019, Mathieu Boudreault, Jean-Francois Renaud:
  - Rozdziały: 1, 8, 18.2, 20.
7. Actuarial Mathematics for Life Contingent Risks, 3<sup>rd</sup> edition, 2020, David Dickson, Mary Hardy, Howard Waters:
  - Rozdziały 12.4, 15, 17.
8. Financial Markets Theory: Equilibrium, Efficiency and Information, 2<sup>nd</sup> edition, 2017, Emilio Barucci, Claudio Fontana:
  - Rozdziały 3.1, 3.2, 5.
9. Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools - revised edition, 2015, Alexander McNeil, Rudiger Frey, Paul Embrechtst:
  - Rozdziały 1.3, 1.4, 1.5, 2, 8.3.2, 8.3.3, 8.4.1-8.4.3, 8.5.
10. EVA/RAROC vs. MCEV Earnings: A Unification Approach, 2013, Christian Kraus, The Geneva Papers on Risk and Insurance - Issues and Practice 38, s. 113–136.

11. Reinsurance: Actuarial and Statistical Aspects, 2017, Hansjörg Albrecher, Jan Beirlant, Jozef Teugels:

- Rozdział 1, 2, 7.3-7.6.