

VÝSKUMNÁ ÚLOHA VEGA č. 1/3800/06:
AKTUÁRSKE MODEL Y V ŽIVOTNOM POISTENÍ
V PODMIENKACH POISTNÉHO TRHU SR PO VSTUPE DO
EURÓPSKEJ ÚNIE

SAKÁLOVÁ Katarína (SR)

Riešiteľský kolektív vedeckého projektu VEGA č. 1/3800/06 Aktuárske model y v životnom poistení v podmienkach poistného trhu Slovenskej republiky po vstupe do Európskej únie tvoria:

Vedúca projektu:

Doc. RNDr. Katarína Sakálová, CSc.

Spoluriešitelia (zmeny počas riešenia a aktuálny stav za r. 2006):

doc. RNDr. Mária Bilíková, PhD., – zástupkyňa vedúcej projektu

prof. RNDr. Vladimír Hut'ka, CSc., – odišiel v júli 2006

RNDr. Viera Sekerová, PhD.

RNDr. Iveta Dirgová Luptáková, PhD., – odišla v januári 2006

Mgr. Ing. Ingrid Krčová, PhD.

Ing. Miroslava Johanesová

V úlohe, ktorá sa rieši od januára 2006, boli nasledujúce výstupy:

- monografia: Sakálová K.: Aktuárske analýzy v životnom poistení,
- vystúpenia na vedeckých konferenciách doma i v zahraničí,
- články v zborníkoch vedeckých konferencií doma i v zahraničí.

Vedecký výskumný kolektív pripravuje ďalšie publikačné výstupy, ktorých vydanie sa očakáva v druhej polovici roka 2007. Členka riešiteľského kolektívu Ing. Johanesová úspešne pokračuje v doktorandskom štúdiu. V školskom roku 2007/08 budú v riešiteľskom kolektíve traja noví doktorandi (2 interní, 1 externý). Tematika ich doktorandských prác bude zameraná na riešenie problematiky výskumnej úlohy.

Činnosť riešiteľského kolektívu bola zameraná popri publikovaní výsledkov vo vedeckých a odborných časopisoch (1 vedecký článok publikovaný v zahraničnom vedeckom nekarentovanom časopise, 2 vedecké články publikované v domácich nekarentovaných

vedeckých časopisoch a 1 odborný článok publikovaný v domácom odbornom časopise) aj na vystúpenia na vedeckých konferenciách a seminároch (2 vedecké konferencie v zahraničí a 3 domáce vedecké konferencie). Vyšla 1 monografia, v štádiu ukončovania je ďalšia monografia a učebnica. V zhode s cieľmi projektu uvedenými vyššie bola táto činnosť obsahovo zameraná na oblasť životného poistenia a na využitie aktuárskej matematiky v tejto oblasti.

Z riešiteľského kolektívu v priebehu roka 2006 odišli prof. Huťka a RNDr. Dirgová Luptáková. Do pokračujúceho projektu sa od roku 2007 po návrate z materskej dovolenky zapojí Mgr. Tatiana Šoltésová.

Riešiteľský kolektív sa v ďalšom období bude venovať najmä:

- ďalším aktuárskym analýzám v oblasti životného poistenia,
- oceňovaní produktov životnej poisťovne so zameraním na kapitálové a investičné životné poistenia,
- ďalší rozvoj matematických modelov aktuárskych výpočtov v životnom poistení s dôrazom na stochastické modelovanie poistenia m-tice osôb,
- testovanie primeranosti rezerv v životnom poistení,
- použitie teórie martingálov v životnom poistení,
- kompatibilitu použitých metodických postupov vo vyššie uvedených oblastiach výskumu s postupmi používanými v zahraničí, najmä v krajinách Európskej únie.

Činnosť riešiteľského kolektívu bude zameraná popri publikovaní výsledkov vo vedeckých a odborných časopisoch aj na vystúpenia na vedeckých konferenciách a seminároch. Riešiteľský kolektív pripraví do tlače ďalšiu monografiu a učebnicu základov aktuárskej matematiky.

Príloha F1

Úplný zoznam výstupov za rok 2006 (prvý rok projektu)

- **monografie**

SAKÁLOVÁ, K.: *Aktuárske analýzy*. Ekonóm Bratislava, 2006, ISBN 80-225-2115-9, (114 strán, 7,5 AH), kat. AAB.

- **nekarentovaný zahraničný vedecký časopis**

SAKÁLOVÁ, K., BILÍKOVÁ, M., PELLER, F.: *With profit contracts*. Strategijski menadžment. Subotica: Ekonomski fakultet, 2006. YU ISSN 0354-8414, podiel 70 %, kat. ADE.

- **nekarentovaný domáci vedecký časopis**

SEKEROVÁ, V.: *Druhý pilier dôchodkovej reformy – problém technickej úrokovej miery*. Ekonomika a informatika 2/2005 (vyšlo v roku 2006), ISSN 1336-3514.

SAKÁLOVÁ, K., MOJŽISOVÁ, E.: *Aktíva životných poisťovní*. Ekonomické rozhľady, 3/2006, Bratislava: EU 2006, ISSN 0323-262X (str. 307 – 315), podiel 50%, kat. ADF.

- **nerecenzovaný domáci odborný časopis**

BILÍKOVÁ, M., FECENKO, J. A KOLEKTÍV: *Vedecko-výskumné zameranie katedier Fakulty hospodárskej informatiky Ekonomickej univerzity v Bratislave*. Dialógy o ekonomike a riadení, roč. VIII, č. 24 (str. 97– 103), podiel 25%, kat. BDF.

- **zborník z konferencie v zahraničí**

BILÍKOVÁ, M., JOHANEŠOVÁ, M.: *Oceňovanie dôchodkov pre dvojicu osôb*.

Zborník z medzinárodnej vedeckej konferencie Evropské finanční systémy, Brno: Ekonomicko-správná fakulta, Masarykova univerzita, 2006. (str. 271 – 276), ISBN 80-210-4018-1, kat. AFC.

KRČOVÁ, I., SAKÁLOVÁ, K.: *Distribúcia prebytku poistencov životnej poisťovne vo forme dividend*. Zborník z medzinárodnej vedeckej konferencie Řízení a modelování finančních rizik, Ostrava: VŠB – Technická univerzita, 2006 (6 strán), ISBN , kat. AFC.

- **zborník abstraktov z domácej konferencie**

BILÍKOVÁ, M., JOHANEŠOVÁ, M.: *Kontingenčné funkcie s časovým intervalom medzi úmrtiami*. Zborník abstraktov z vedeckej konferencie „Aktuárske vedy v podmienkach poisťného trhu slovenskej republiky, Virt, FHI EU Bratislava, 2006. (str. 5), kat. AFH.

KRČOVÁ, I.: *Test primeranosti technických rezerv v životnom poistení*. Zborník abstraktov z vedeckej konferencie „Aktuárske vedy v podmienkach poisťného trhu slovenskej republiky, Virt, FHI EU Bratislava, 2006. (str. 9), kat. AFH.

SAKÁLOVÁ, K., MOJŽISOVÁ, E.: *Investičná politika životnej poisťovne*. Zborník abstraktov z vedeckej konferencie „Aktuárske vedy v podmienkach poisťného trhu slovenskej republiky, Virt, FHI EU Bratislava, 2006. (str. 11), podiel 50%, kat. AFH.