

AKTUARVEREINIGUNG
ÖSTERREICHS

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

TECHNISCHE UNIVERSITÄT
WIEN

FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Dietmar Pfeifer

Carl von Ossietzky Universität Oldenburg, Deutschland
<http://www.mathematik.uni-oldenburg.de/>

Zur Bedeutung der Modellierung abhängiger Risiko-Prozesse für die europäische Versicherungswirtschaft

Die europäischen Aufsichtsbehörden eröffnen im Rahmen von "Solvency II" die Möglichkeit, mit geeigneten "internen Modellen" eine individuelle Risikoerfassung und -modellierung zum Zweck der Bestimmung des Solvabilitätskapitals zu etablieren. Dies stellt neue Herausforderungen insbesondere an eine möglichst genaue Modellierung der verschiedenen Verflechtungen der versicherungstechnischen Risiken untereinander, aber auch mit den finanziellen Risiken der Kapitalanlage-seite. In dem Vortrag sollen Wege aufgezeigt werden, wie Modellierungen abhängiger Risiken insbesondere unter Einbezug der zeitlichen Komponente prinzipiell geschehen können. Hierbei spielen geeignete Copulas für markierte Punktprozesse eine wichtige Rolle, die sowohl positive wie auch negative Abhängigkeiten zulassen. Insbesondere der letztgenannte Aspekt besitzt im Zusammenhang mit der Problematik kommerzieller geophysikalischer Modelle für Naturkatastrophen eine besondere Bedeutung.

D. Pfeifer: Solvency II: Neue Herausforderungen an Schadenmodellierung und Risikomanagement? In: Risikoforschung und Versicherung. Festschrift für Elmar Helten, P. Albrecht, E. Lorenz und B. Rudolph, Hrsg., VVW Karlsruhe (2004), 467 - 481.

D. Pfeifer and J. Neslehova: Modeling and generating dependent risk processes for IRM and DFA. ASTIN Bulletin, Vol. 34, No. 2 (2004), 333 - 360.

Dietmar Pfeifer ist Professor für "Angewandte Mathematik" an der Universität Oldenburg, wissenschaftlicher Berater für AON Jauch und Hübner Hamburg und Vorstandsmitglied der DGVFM.

Termin: Dienstag, **5. April 2005**, 16:30 Uhr s.t.

Ort: **Technische Universität Wien**
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8-10
Freihaus, Turm B (grüner Bereich), 2. Stock,
Hörsaal FH 6

Webseite: <http://www.fam.tuwien.ac.at/vr/>

Direktor Helmut Holzer
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins
der Versicherungsmathematik

Gen.-Dir. Dr. Siegfried Sellitsch
Präsident der Österr. Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien

o.Univ.-Prof. Dr. W. Schachermayer
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien