

AKTUARVEREINIGUNG
ÖSTERREICHS

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

TECHNISCHE UNIVERSITÄT
WIEN

FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Klaus D. Schmidt

Institut für Versicherungsmathematik, Technische Universität Dresden
<http://www.math.tu-dresden.de/sto/schmidt/>

Bornhuetter-Ferguson & Co.: Eine Familie von Verfahren der Schadenreservierung

Das Bornhuetter-Ferguson Verfahren ist, wie das Chain-Ladder Verfahren, eines der prominentesten Verfahren der Schadenreservierung. Beide Verfahren beruhen auf Abwicklungsdreiecken, und in der aktuariellen Praxis werden sie auch variiert oder kombiniert. Dennoch werden sie gelegentlich, wie auch das Chain-Ladder Verfahren und das additive Verfahren (Verfahren der anfallsjahrunabhängigen Schadenquotenzuwächse), als gegensätzlich empfunden.

Im Vortrag wird gezeigt, dass diese Gegensätze sich auflösen, wenn das Bornhuetter-Ferguson Verfahren nicht als ein spezielles Verfahren sondern als ein allgemeines Prinzip der Schadenreservierung verstanden wird. Zu diesem Zweck wird der Begriff des Abwicklungsmusters formalisiert und damit die Vergleichbarkeit verschiedener Verfahren hergestellt. Es stellt sich heraus, dass das Bornhuetter-Ferguson Prinzip zahlreiche Verfahren umfasst (additiv, Chain-Ladder, Cape-Cod, ...) und auf ein sehr allgemeines Verfahren führt, das verschiedenartige Informationsquellen (Abwicklungsdaten, Prämien, Marktstatistiken, ...) und deren Bewertung durch den Aktuar berücksichtigt.

Klaus D. Schmidt ist Inhaber des Lehrstuhls für Versicherungsmathematik an der Technischen Universität Dresden. Es studierte an den Universitäten in Kiel und Zürich, arbeitete dann als Assistent an der Universität Zürich und an der École Polytechnique Fédérale de Lausanne und war danach in verschiedenen Positionen an der Universität Mannheim tätig, wo er auch promovierte und sich habilitierte. Sein Arbeitsgebiet ist die Mathematik der Schadenversicherung. Dabei gilt sein besonderes Interesse der stochastischen Modellierung und der Weiterentwicklung von Verfahren der Schadenreservierung.

Termin: Dienstag, 16. Mai 2006, 16:30 Uhr s.t.

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

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

Mag. Dr. Klaus Wegenkittl
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. Walter Schachermayer
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien