

AKTUARVEREINIGUNG ÖSTERREICHS

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

VIENNA INSTITUTE OF FINANCE

TECHNISCHE UNIVERSITÄT WIEN
FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

UNIVERSITÄT WIEN
FAKULTÄT FÜR MATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Dr. Mario Wüthrich

ETH Zürich

<http://www.math.ethz.ch/~wueth/>

Modellierung des Abwicklungsergebnisses im neuen Solvenz-Modell

Wir nehmen an, dass der Schadenerledigungsprozess die Annahmen des verteilungsfreien Chain Ladder (CL) Modelles erfüllt. Wir können dann die zukünftigen Schadenzahlungen zur Zeit t und zur Zeit $t+1$ (mit der zur Verfügung stehenden Information) vorhersagen. Die Differenz dieser zwei Vorhersagen ist das sogenannte Abwicklungsergebnis. Dieses Abwicklungsergebnis ist ein wichtiger Bestandteil der Erfolgsrechnung einer Nicht-Lebens-Versicherung, und deshalb muss die Unsicherheit in deren Prognose unter Solvenz 2 bewertet werden. Diese Analyse bestimmt das notwendige risikotragende Kapital für das Abwicklungsergebnis. Wir studieren diese Unsicherheiten innerhalb des CL Modelles.

Zur Person: Dr. Mario Wüthrich arbeitet als Dozent und Senior Researcher an der ETH Zürich. Nach seinem Doktorat in Mathematik an der ETH Zürich und seinem Postdoktorat an der Universität Nijmegen (NL), hat er während 5 Jahren im Bereich Schadenreservierung für die Winterthur Versicherung gearbeitet. Seit 2005 ist er nun an der ETH Zürich, wo er im Bereich Finanz- und Versicherungsmathematik unterrichtet. Neben verschiedenen Publikationen ist 2008 sein Buch mit Michael Merz „Stochastic Claims Reserving Methods in Insurance“ bei Wiley erschienen. Im weiteren dient er als Vorstandsmitglied in der Schweizerischen Aktuarsvereinigung (SAV) und ist Editor der Mitteilungen der SAV.

Termin: Dienstag, 6. Oktober 2009, 16:30 Uhr s.t.

Ort: Technische Universität Wien
1040 Wien, Karlsplatz 13
Hauptgebäude Stiege VII, Erdgeschoß,
HS 7 Schütte-Lihotzky Hörsaal

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

Für Aktuare zählt der Besuch des Vortrages als Weiterbildung (ein CPD-Punkt). Für eine entsprechende Bestätigung melden Sie sich bitte vorab per E-Mail mit Namen und Postanschrift im Sekretariat bei Herrn Christian Gawrilowicz (secr@fam.tuwien.ac.at) an.

Mag. Christoph Krischanitz
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins
der Versicherungsmathematik

Dkfm. Dr. Siegfried Sellitsch
Präsident der Österreichischen Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

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

o.Univ.-Prof. Walter Schachermayer
Institut für Mathematik, Universität Wien

Univ.-Prof. Dr. Damir Filipović
Vienna Institute of Finance