

AKTUARVEREINIGUNG ÖSTERREICHS

TECHNISCHE UNIVERSITÄT WIEN
FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

UNIVERSITÄT WIEN
FAKULTÄT FÜR MATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Klaus D. Schmidt

Lehrstuhl für Versicherungsmathematik
Technische Universität Dresden

Lineare Modelle in der Schadenreservierung: Korrelation, Prognose, und Prognosefehler

Lineare Modelle bilden einen vereinheitlichenden Rahmen für die Modellierung vieler bekannter Verfahren der Schadenreservierung und gleichzeitig ein allgemeines Prinzip für die Konstruktion neuer Verfahren.

Sie gestatten die Bestimmung optimaler Prognosen für zukünftige Schadenstände und Zuwächse und damit die optimale Bestimmung von Reserven durch die Minimierung des erwarteten quadratischen Prognosefehlers (Gauss-Markov-Eigenschaft). Ein wesentlicher Vorteil besteht in der Berücksichtigung von Korrelationen und in der Konsistenz der Prognosen für einen Bestand und seine Teilbestände sowie für die Gesamtreserve und die Kalenderjahresreserve. Grundsätzlich können in einem linearen Modell auch die Prognosefehler exakt bestimmt und leicht geschätzt werden.

Zur Person: Klaus D. Schmidt ist Inhaber des Lehrstuhls für Versicherungsmathematik an der Technischen Universität Dresden. Nach dem Studium an den Universitäten Kiel und Zürich war er an der Universität Zürich, an der Ecole Polytechnique Fédérale de Lausanne und 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. Er ist Verfasser des Lehrbuchs "Versicherungsmathematik" und hat gemeinsam mit Michael Radtke das "Handbuch zur Schadenreservierung" herausgegeben. Er ist Mitglied mehrerer Gremien der Deutschen Aktuar-Vereinigung (DAV) sowie Dozent an der Deutschen Aktuar-Akademie (DAA) und im Sommersemester 2009 Gastprofessor am SIAS.

Termin: Dienstag, 18. Mai 2010, 16:30 Uhr s.t.

Ort: **Technische Universität Wien**
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8–10
Freihaus, Turm B (gelber Bereich), 2. Stock,
Freihaus Hörsaal 4

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

Für Aktuarre 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

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

Dr. Franz Kronsteiner
Präsident der Österreichischen Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

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