

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Assoc.Prof. Dr. Johanna G. Nešlehová

Department of Mathematics and Statistics, McGill University, Montréal, Canada

Wie kann man Abhängigkeiten zwischen diskreten und gemischten Risiken aufdecken?

Copula-basierte Abhängigkeitsmodelle werden zunehmend zur Beschreibung und Analyse von multivariaten Risiken eingesetzt. Es zeigt sich jedoch, dass sobald Bindungen in den Daten auftreten, wie dies z.B. bei Zählvariablen der Fall ist, können die in den letzten Jahren entwickelten rangbasierten statistischen Verfahren nicht mehr ohne Weiteres eingesetzt werden. In diesem Vortrag wird die sog. empirische Schachbrettcopula als eine vielversprechende Basis für konsistente statistische Verfahren vorgestellt und das asymptotische Verhalten des zugehörigen empirischen Prozesses untersucht. Die Ergebnisse führen u.a. zu neuen Unabhängigkeitstests, die überraschend gute Eigenschaften vorweisen und sowie für diskrete als auch für gemischte oder stetige Risiken verwendet werden können.

Zur Person: Johanna G. Nešlehová ist seit 2009 Professorin für Statistik im Department für Mathematik und Statistik an der Universität McGill in Montréal, Kanada. Nach ihrem Studium der Mathematik und mathematischen Statistik in Prag, Hamburg und Oldenburg, war sie an der ETH Zürich tätig, zunächst als Postdoktorandin im RiskLab Switzerland und später als Heinz Hopf Lecturer im Departement Mathematik. Sie beschäftigt sich u.a. mit stochastischen Abhängigkeitsmodellen, Extremwerttheorie, nichtparametrischen und asymptotischen Verfahren sowie Anwendungen in der Versicherungs- und Finanzmathematik und Biostatistik.

Termin: Dienstag, 9. April 2013, 16:30 Uhr (pünktlich)

Ort: Technische Universität Wien
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8–10
Freihaus, Turm A (grüner Bereich), 6. Stock,
Seminarraum 107

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

Für Aktuarien 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 Frau Sandra Trenovatz (sandra@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. Thorsten Rheinländer
Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM), TU Wien