

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Univ.Prof. Christian Genest, PhD

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

Accounting for extreme-value dependence in multivariate data

Insurance claim data often exhibit fat-tail behavior. This phenomenon is well documented and can be analyzed by standard statistical tools. In contrast, extreme-value dependence in multivariate claim data or between financial assets is seldom recognized. This talk will describe how to test, measure and account for extreme dependence from a copula modeling perspective.

Zur Person: Christian Genest is Professor of Statistics and Canada Research Chair in the Department of Mathematics and Statistics at McGill University, Montréal, Canada. He is also Director of the Institut des sciences mathématiques du Québec. His primary research focus lies in dependence modeling, nonparametric statistics, and extreme-value theory. He has published extensively on statistical methodology and collaborates regularly with researchers in finance and insurance. He has served in various capacities, including as Editor of "The Canadian Journal of Statistics" and President of the Statistical Society of Canada. His work earned him the prestigious SSC Gold Medal in 2011; he is also an ASA and IMS Fellow.

Termin: Dienstag, 9. April 2013, 17:30 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 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 Frau Sandra Trenovatz (sandra@fam.tuwien.ac.at) an.

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

Dr. Franz Kronsteiner
Präsident der Österreichischen Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

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

Univ.-Prof. Dr. Thorsten Rheinländer
Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM), TU Wien