

Einladung
zu einer Vorlesung über
Fortgeschrittene statistische Methoden im Versicherungswesen

von 1. bis 4. Oktober 2008
an der Universität Salzburg

- Vortragende: Prof. Dr. Marcus Hudec
Institut für Scientific Computing der Universität Wien
Geschäftsführer der Data Technology Betriebsberatungsgesellschaft, Wien
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Dr. Michael Schlögl
Leiter des Bereichs Kraftfahrzeugversicherung
Mitglied der erweiterten Geschäftsleitung
Wiener Städtische Versicherung AG – Vienna Insurance Group, Wien
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine: Mi. 1. Okt. 9.00–13.00 und 14.30–18.00 Uhr
Do. 2. Okt. 9.00–13.00 und 14.30–18.00 Uhr
Fr. 3. Okt. 9.00–13.00 und 14.30–16.30 Uhr (19.00 Uhr Konzert und Empfang)
Sa. 4. Okt. 9.00–12.00 Uhr
- Inhalt: Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse fortgeschrittener statistischer Methoden im Versicherungswesen, die nach den Richtlinien sowohl der Aktuarvereinigung Österreichs als auch der Deutschen Aktuarvereinigung Voraussetzung für die Anerkennung als Aktuar sind. Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter gemäß § 24 öVAG. Als Weiterbildungsveranstaltung (CPD) ist die Vorlesung im Umfang von 21 Stunden anrechenbar. Die Methoden und Modelle werden anhand konkreter Anwendungen veranschaulicht (Tarifizierung und Reservierung, Optimierung von Cross- und Upselling-Kampagnen im Versicherungsvertrieb). Dabei steht eine praxisnahe, datenorientierte Betrachtungsweise im Vordergrund. Die Teilnahme steht allen Personen offen, die sich Kenntnisse über fortgeschrittene statistische Methoden im Versicherungswesen verschaffen wollen. Die Einladung zur Teilnahme richtet sich ausdrücklich auch an erfahrene Praktiker. Grundkenntnisse der Stochastik werden vorausgesetzt. Die Gliederung der Vorlesung finden Sie auf der Rückseite.
- Kostenbeitrag: €796. Der Kostenbeitrag beinhaltet die 4 Nächtigungen von Dienstag bis Samstag im Parkhotel Castellani einschließlich Frühstücksbuffet. Für Teilnehmer, die keine Hotelunterkunft benötigen, beträgt der Kostenbeitrag €480. Die Mittagessen, die Kaffeepausen sowie die Abendveranstaltung am Freitag sind inbegriffen.
- Auskünfte: Für weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Frau Sarah Lederer per Fax (+43-662-8044-155) oder E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at). Bitte fügen Sie Ihre Telefonnummer hinzu. Ihre Fragen werden so bald wie möglich beantwortet.

Bitte wenden.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder faxen Sie es an +43-662-8044-155, und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 29. August 2008 auf das folgende Konto. Nach diesem Stichtag ist eine Anmeldung mit Hotelunterkunft nur auf Anfrage möglich. Für Teilnehmerinnen und Teilnehmer, die keine Hotelunterkunft benötigen, können Anmeldung und Überweisung bis 12. September 2008 erfolgen.

Salzburg Institute of Actuarial Studies (SIAS)
IBAN: AT 792 040 400 000 012 021 BIC: SBGSAT2S

Ort: Hörsaal 402 der Naturwissenschaftlichen Fakultät
A-5020 Salzburg, Hellbrunner Straße 34

Das Konzert und der Empfang am Freitagabend finden in der Max-Gandolph-Bibliothek statt, einem historischen Saal in der Salzburger Altstadt.

Gliederung der Vorlesung

Erster Teil: Fortgeschrittene statistische Methoden zur Tarifierung und Reservierung

1. Ausgleichsverfahren

Versicherungsprinzip, Ausgleich von Rohdaten, Tarifierung bei mehrfacher Klassifikation

2. Allgemeines lineares Modell

Einfache und multiple Regression, Varianz- und Kovarianzanalyse, Modellierung von Nicht-linearitäten

3. Alternative Ansätze

Robuste Verfahren, Ridge-Regression, gewichtete kleinste Quadrate

4. Verallgemeinertes lineares Modell

Modellstruktur, logistische Regression, log-lineare Modelle

5. Credibility-Modelle

Credibility-Ansatz nach Bühlmann-Straub

6. Monte-Carlo-Simulation

Simulation von Zufallsvariablen, Bootstrapping, Simulation von stochastischen Prozessen

7. Multivariate Daten

Visualisierung, Hauptkomponentenanalyse, lineare Diskriminanzanalyse nach Fisher

Zweiter Teil: Konzepte des Data Minings am Beispiel der Optimierung von Cross- und Upselling-Kampagnen im Versicherungsvertrieb

1. Allgemeine Vorgehensmodelle für Data Mining

CRISP-DM, Evaluation von Modellen und Überanpassung

2. Regression

Regressionsbäume, neuronale Netze

3. Supervised Learning (Klassifikation)

Klassifikationsbäume, Support Vector Machines, neuronale Netze

4. Unsupervised Learning (Clustering)

Hierarchische Verfahren, k-Mittel, Mischverteilungen

Bei Bedarf (Anwesenheit nicht deutschsprachiger Teilnehmerinnen oder Teilnehmer) wird die Vorlesung in englischer Sprache gehalten.