

Einladung zu einer Vorlesung über Schadenversicherungsmathematik

im Sommersemester 2019
an der Universität Salzburg

- Vortragender:** Univ.-Prof. Dr. Klaus D. Schmidt
Inhaber einer Seniorprofessur an der Universität Mannheim
Emeritierter Ordinarius der Technischen Universität Dresden
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine:** jeweils Freitag 15–19 Uhr und Samstag 9–13 Uhr am
29. und 30. März 2019
10. und 11. Mai 2019
14. und 15. Juni 2019
- Inhalt:** Es wird ein Überblick über die zentralen Fragestellungen und Methoden der Schadenversicherungsmathematik gegeben. Insbesondere werden die Bedeutung des kollektiven Modells in der Tarifierung und in der Rückversicherung dargestellt und neuere Entwicklungen in der Schadenreservierung berücksichtigt.
- Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse der Schadenversicherungsmathematik, die nach den Richtlinien der Aktuarvereinigung Österreichs (<http://www.sias.at/avoe>) Voraussetzung für die Anerkennung als Aktuar sind und den Anforderungen der Deutschen Aktuarvereinigung entsprechen (<http://www.sias.at/dav>). Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter (§§ 114 – 116 VAG), zum Leiter der versicherungsmathematischen Funktion oder dessen Stellvertreter (§ 113 VAG) sowie zum Leiter der Risikomanagement-Funktion oder dessen Stellvertreter (§ 112 VAG). Als Weiterbildungsveranstaltung (CPD) ist die Vorlesung im Umfang von 21 Stunden anrechenbar. Die Einladung zur Teilnahme richtet sich ausdrücklich auch an erfahrene Praktiker. Grundkenntnisse der Stochastik werden vorausgesetzt. Die Gliederung der Vorlesung finden Sie auf der folgenden Seite.
- Kostenbeitrag:** € 594 (inkl. USt.) ohne Hotelunterkunft, € 948 (inkl. USt.) mit Unterkunft jeweils von Freitag auf Samstag (3 Nächtigungen) im Arcotel Castellani einschließlich Frühstücksbuffet. Die Kaffeepausen sind in beiden Beträgen inbegriffen.
- Auskünfte:** Für weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Frau Sarah Lederer per E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at). Bitte fügen Sie Ihre Telefonnummer hinzu. Ihre Fragen werden so bald wie möglich beantwortet.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder per E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at), und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 8. März 2019 auf das folgende Konto:

Salzburg Institute of Actuarial Studies (SIAS)
IBAN: AT79 2040 4000 0001 2021 BIC: SBGSAT2S

Ort: Naturwissenschaftliche Fakultät, Hörsaal 402
5020 Salzburg, Hellbrunner Straße 34

Gliederung der Vorlesung

1 Risikomodelle

- a. Individuelles Modell (Verteilung des Gesamtschadens, Ungleichung von Cantelli, Ruinwahrscheinlichkeit)
- b. Kollektives Modell (Verteilung des Gesamtschadens, Rekursion von Panjer)
- c. Nettoprämie im kollektiven Modell mit Selbstbehalt und Beitragsrückerstattung

2 Tarifierung

- a. Konstruktion eines multiplikativen Tarifs
- b. Bonus-Malus-Systeme (Konstruktion mit Hilfe von Markov-Ketten, Stabilität)
- c. Sicherheitszuschlag und Prämienprinzipien (Quantilsprinzip, Standardabweichungsprinzip, Nullnutzenprinzip und andere)

3 Risikoteilung und Rückversicherung

- a. Proportionale Rückversicherung (Quote und Summenexzedent)
- b. Nichtproportionale Rückversicherung (Einzelschadenexzedent, Kumulschadenexzedent, Jahresschadenexzedent)
- c. Rückversicherungsprogramm (Kombination verschiedener Formen der Rückversicherung)

4 Schadenreservierung

- a. Abwicklungsdaten (Abwicklungsdreiecke, Volumenmaße, Schadenquoten) und Abwicklungsmuster
- b. Elementare Verfahren und Bornhuetter-Ferguson-Prinzip (Vergleich der elementaren Verfahren, verwandte neue Verfahren, Analyse der Abwicklungsdaten und der in den Verfahren verwendeten Information)
- c. Schadenreservierung im Linearen Modell (Korrelation zwischen Teilbeständen, Konsistenz der Prognosen, Schätzung des Prognosefehlers)

Eine detailliertere Orientierung über die Inhalte der Vorlesung bietet das Buch Schadenversicherungsmathematik (Springer, 2016), bei dem der Vortragende einer der Autoren ist.

Die Vorlesung wird in deutscher Sprache gehalten.