AKTUARVEREINIGUNG ÖSTERREICHS

UNIVERSITÄT SALZBURG

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

Salzburg Institute of Actuarial Studies 5020 Salzburg, Hellbrunner Straße 34

Einladung zu einer Vorlesung über Statistische Methoden im Versicherungswesen, Teil A

im Wintersemester 2005/2006 an der Universität Salzburg

Vortragender: Dipl.-Math. Dr. rer. pol. Richard Herrmann

Mitglied des Vorstands der Heubeck AG, Köln Gastprofessor an der Universität Salzburg

Termine: jeweils Freitag 9–13 Uhr am

14. Oktober 20054. November 200518. November 200516. Dezember 200513. Jänner 200627. Jänner 2006

Inhalt:

Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse statistischer Methoden im Versicherungswesen, die nach den Richtlinien sowohl der Aktuarvereinigung Österreichs als auch der Deutschen Aktuarvereinigung Voraussetzung für die Anerkennung als Aktuar und nach den Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht Voraussetzung für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar gemäß § 24 VAG sind. Die Teilnahme steht allen Personen offen, die sich vertiefte Kenntnisse über statistische Methoden im Versicherungswesen aneignen 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:

894 Euro. Der Kostenbeitrag beinhaltet die 6 Nächtigungen von Donnerstag

auf Freitag in einem ****-Hotel einschließlich Frühstücksbuffet.

Für Teilnehmer, die keine Übernachtungsmöglichkeit benötigen, beträgt der

Kostenbeitrag 444 Euro.

Auskünfte:

Falls Sie Fragen haben, schicken Sie bitte Ihre Telefonnummer per Fax an 0662-8044-155 oder per E-Mail an sarah.lederer@sbg.ac.at. Sie werden

so bald wie möglich zurückgerufen.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder faxen Sie

es an 0662-8044-155, und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 7. Oktober 2005 auf das Konto 12021 lautend auf "Salzburg Institute of

Actuarial Studies (SIAS)" bei der Salzburger Sparkasse (BLZ 20404).

Ort: Hörsaal 414 der Naturwissenschaftlichen Fakultät

5020 Salzburg, Hellbrunner Straße 34

Gliederung der Vorlesung

Teil A (WS 2005/06):

- Verteilungen und Quantilsfunktionen
 - eindimensionale diskrete und stetige Verteilungen
 - spezielle Verteilungen für die Risiko-Modellierung (ein- und mehrdimensional)
- Risikomessung
 - Komponenten des Zufalls- und Modellrisikos
 - Quantifizierung durch Risikomaße
- Stochastische Risiko-Modellierung
 - grundlegende stochastische Prozesse
 - Abhängigkeitsstrukturen
 - Zeitreihenanalyse
- Monte-Carlo-Simulation
 - Simulation von Zufallsvariablen und stochastischer Prozesse
- Datenanalyse
 - Durchführung der Datenerhebung
 - Aufbereitung der Daten und Ergebnisse

Teil B (Vorschau auf das SS 2006):

- Punktschätzung
 - Maximum-Likelihood-Schätzer und numerische Umsetzung
 - Bayessche Statistik
- Credibility
 - Bayes-Ansatz und Ansatz von Bühlmann-Straub
- Hypothesentests
 - Mindeststichprobengrößen und klassische Testverfahren
 - Likelihood-Quotiententest
 - nichtparametrische Testverfahren
- Verallgemeinerte Lineare Modelle
 - Regression und Varianzanalyse
- Biometrische Rechnungsgrundlagen
 - Methoden zur Ermittlung der Rohwahrscheinlichkeiten
 - Ausgleichsverfahren und Berücksichtigung von Trends
 - Berücksichtigung von Risiken
 - Kopfschadenmodelle in der privaten Krankenversicherung
- Data-Mining
 - Hauptkomponentenanalyse
 - Diskriminanzanalyse

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