

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Hansjörg Albrecher

Department of Actuarial Science, University of Lausanne

Messung von Versicherungsrisiken und das Omega-Modell

Das klassische Kriterium der kollektiven Risikotheorie für die Solvenz eines Versicherungsportfolios ist die Ruinwahrscheinlichkeit, für die es zahlreiche elegante mathematische Resultate gibt. In der Versicherungspraxis wird (etwa im Solvency II - Kontext) hingegen meist der Value-at-Risk als Risikomass verwendet. In diesem Vortrag sollen Vor- und Nachteile unterschiedlicher Ansätze in der Messung von Versicherungsrisiken diskutiert werden, und es wird eine Verallgemeinerung des klassischen Ruinbegriffs vorgestellt. Weiters wird der Einfluss von Transaktionskosten auf die optimalen Investment-Strategien in einem Versicherungsportfolio untersucht.

Zur Person: Hansjoerg Albrecher is seit 2009 Professor für Versicherungsmathematik an der Universität Lausanne sowie Fakultätsmitglied des Swiss Finance Institute. Nach seinem Studium der Technischen Mathematik in Graz, Limerick und Baltimore war er an der TU Graz, der K.U. Leuven und Universität Aarhus tätig, bevor er für mehrere Jahre am Radon-Institut der österreichischen Akademie der Wissenschaften in Linz die Forschungsgruppe Finanzmathematik leitete. Hansjörg Albrecher beschäftigt sich u.a. mit Risikotheorie, Solvenzkriterien für Versicherungsunternehmen, optimalen Rückversicherungsstrategien sowie Verbindungen von Versicherungs- und Finanzmathematik.

Termin: Dienstag, 25. Oktober 2011, 15:30 Uhr (pünktlich)

Ort: **Technische Universität Wien**
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8–10
Freihaus, Turm B (gelber Bereich), 2. Stock,
Freihaus Hörsaal 4

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 Aleksandra Zivkovic (secr@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. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien