

Seminareinladung

**Donnerstag, 05. November 2009
und Freitag, 06. November 2009**

Thema :

„stochastische Schaden-Reservierung “

beginnt 09:30 Uhr am 05.11.2009 und endet um 16:30 Uhr am 06.11.2009

Ort : Hotel Modul, 1190 Wien, Peter Jordan Straße 78

Seminargebühr : (inkl. Mittagessen und Pausengetränke)

AVÖ –Mitglieder € 800,- inkl. USt.

Nicht-Mitglieder € 1.000,- inkl. USt.

Studenten (AVÖ –Mitglieder) € 500,- inkl. USt.

Studenten (nicht –Mitglieder) € 700,- inkl. USt.

Als Studenten können nur Personen ohne Berufstätigkeit anerkannt werden.

Inhalt :

Mag. Christoph Krischanitz – Präsident der AVÖ

Begrüßung und Einleitung

Dr. Thomas Mack - München

Referent und Seminarleitung

1. Grundlagen
2. Methode der unabhängigen Schadenquotenzuwächse
3. Chain Ladder Methode
4. Prüfen und Verbessern der Modelle
5. Munich Chain Ladder Methode
6. Bornhuetter/Ferguson Methode
7. Kreuzklassifizierte Methoden
8. Bayessche und Credibility Methoden
9. Fazit, Literaturhinweise

Zwei-Tage-Seminar über stochastische Schaden-Reservierung

Vortragender : Dr. Thomas Mack, München

Die mathematischen Verfahren der Schadenreservierung werden nicht nur für den Jahresabschluss und die interne Erfolgsrechnung benötigt, sondern auch für Tarifikalkulation und interne Risikomodellierung (Solvency II). Insbesondere für Diskussionen mit Wirtschaftsprüfern und Rating Agenturen sowie für die Konstruktion von Risikomodellen ist das richtige Verständnis der Variabilität der Reserveschätzung von überragender Bedeutung.

In dem Seminar werden die wichtigsten Reservierungsmethoden und ihr jeweils zu Grunde liegendes stochastisches Modell erläutert und analysiert. Dies ermöglicht es den Teilnehmern, die Methoden und ihre Konsequenzen besser zu verstehen, sowie zu untersuchen, ob die Methode zu den Daten passt, und die Variabilität der Reserveschätzung (Prognosefehler, Konfidenzbereich) zu berechnen. Beispiele und Formeln für den Prognosefehler werden besprochen. Die Seminarunterlagen enthalten auch vieles, was bisher noch nicht veröffentlicht ist.

Die Teilnehmer sollten ein solides Grundwissen in Wahrscheinlichkeitsrechnung und Mathematischer Statistik haben. Auch tiefer gehende Techniken werden benutzt, aber zuvor erläutert. Einen realistischen Eindruck vom Niveau des Seminars geben die folgenden Veröffentlichungen:

Mack, Th. (1994): Measuring the Variability of Chain Ladder Reserve Estimates. CAS Spring Forum 1994, 101-182. (*einfach*)
<http://www.casact.org/pubs/forum/94spforum/94spf101.pdf>

Mack, Th. (2006): Parameter Estimation for Bornhuetter/Ferguson. CAS Fall Forum 2006, 141-157. (*einfach*)
<http://www.casact.org/pubs/forum/06fforum/145.pdf>

Mack, Th. (1993): Distribution-free Calculation of the Standard Error of Chain Ladder Reserve Estimates. ASTIN Bulletin 23, 213-225. (*tiefer gehend*)
<http://www.casact.org/library/astin/vol23no2/213.pdf>

Mack, Th. (2000): Credible Claims Reserves: The Benktander Method. ASTIN Bulletin 30, 333-347. (*tiefer gehend*)
<http://www.casact.org/library/astin/vol30no2/333.pdf>

Bitte bis spätestens **28. Oktober 2009** zurücksenden an :
ÖFdv – Sekretariat - Helga Prieler
A - 7002 Eisenstadt , Postfach 1
FAX : +43 / (0)2682 / 72794-0

Seminar - Anmeldung
2- Tages Seminar
„stochastische Schaden-Reservierung “

Beginn : Donnerstag, 05. November 2009 um 09:30 Uhr
Ende : Freitag, 06. November 2009 um 16:30 Uhr

Ort : Hotel Modul, 1190 Wien, Peter Jordan Straße 78

Die Rechnung über den Seminarbeitrag wird Ihnen umgehend übermittelt und ist sofort fällig.

Name

Vorname

Titel

Firma (wenn Rechnungslegung
an Firma erwünscht)

Straße

PLZ – Ort

Email Adresse

Ich melde mich für dieses 2 Tages Seminar des ÖFdv am Donnerstag, 05. November 2009 und
Freitag 06. November 2009 verbindlich an.

.....
Datum

.....
Unterschrift