

105.055 Seminar

Versicherungsmathematik

Reinhold KAINHOFER und Johannes LEITNER

Ziel

Eigenständiges Erarbeiten und Präsentieren eines vertiefenden Gebiets der Versicherungsmathematik oder einer wichtigen Publikation.

Themen

Es sollen verschiedene vertiefende Themenbereiche der Versicherungsmathematik und deren Grundlagen selbst erarbeitet und in Vortragsform (Folien, Tafel, Laptop, ...) präsentiert werden. Dies kann entweder eine wichtige aktuelle Veröffentlichung sein, die von Studenten durchgearbeitet und präsentiert wird, oder ein Themengebiet, das in den bisherigen Vorlesungen zu kurz gekommen ist.

Vorschläge unsererseits umfassen u.a.:

- Das Choquet-Integral (1-2 Vorträge)
- Die folgende Arbeit aus der Ruintheorie: H. U. Gerber and E. S. W. Shiu. On the time value of ruin. *N. Am. Actuar. J.*, 2(1):48–78, 1998
- Simulation in der Versicherungsmathematik
- Risikomaße: Value at Risk, Expected Shortfall, etc. (1-2 Vorträge)
- Projektion von Sterbetafeln in die Zukunft: Einige theoretische Modelle (Lee-Carter, log-bilineares Poisson-Modell, etc.), Rentnerselektion
- "Stochastic Control" und Anwendungen in der Versicherungsmathematik (z.B. C. Hipp. Stochastic control with application in insurance. Skript, auf dessen Homepage verfügbar)
- ...

Termine

Vorbesprechung: Mittwoch, 6. Oktober 2004, 18:00-18:15 Uhr
Ort: FH Hörsaal 4, Freihaus, 2. Stock