

**Einladung
zu einer Vorlesung über
Schadenversicherungsmathematik**

im Wintersemester 2006/2007
an der Universität Salzburg

- Vortragender: ao.Univ.-Prof. Dipl.-Ing. Dr. Matthias Reitzner, TU Wien
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine: jeweils Freitag 16–19 Uhr und Samstag 9–12 Uhr am
6. und 7. Oktober 2006
20. und 21. Oktober 2006
10. und 11. November 2006
24. und 25. November 2006
12. und 13. Jänner 2007
26. und 27. Jänner 2007
- Inhalt: Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse der Schadenversicherungsmathematik, die nach den Richtlinien sowohl der Aktuarvereinigung Österreichs als auch der Deutschen Aktuarvereinigung Voraussetzung für die Anerkennung als Aktuar sind. Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter gemäß § 24 VAG. Die Teilnahme steht allen Personen offen, die sich mit den zentralen Fragestellungen und Methoden der Schadenversicherungsmathematik vertraut machen wollen. Grundkenntnisse der Stochastik werden vorausgesetzt. Die Gliederung der Vorlesung finden Sie auf der Rückseite.
- Kostenbeitrag: € 948. Der Kostenbeitrag beinhaltet die 6 Nächtigungen von Freitag auf Samstag in einem ****-Hotel einschließlich Frühstücksbuffet.
Für Teilnehmer, die keine Übernachtungsmöglichkeit benötigen, beträgt der Kostenbeitrag €444.
- 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.

Bitte wenden.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder faxen Sie es an 0662-8044-155, und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 15. September 2006 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

1. Risikomodelle

- Individuelles Modell der Risikotheorie
- Kollektives Modell der Risikotheorie
- Schadenanzahlverteilungen
- Schadenhöhenverteilungen
- Gesamtschadenverteilungen
- Approximation von Gesamtschadenverteilungen

2. Ruintheorie

- Ruinwahrscheinlichkeiten
- Schwankungsrückstellungen
- Großschäden
- Solvabilität

3. Prämienkalkulation

- Prämienkalkulationsprinzipien
- Bonus-Malus-Systeme
- Bildung von Risikoklassen

4. Schadenreservierung

- Abwicklungsdreiecke
- Chain-Ladder-Verfahren

5. Risikoteilung

- Quoten-Rückversicherung
- Exzedenten-Rückversicherung
- Stop-Loss-Rückversicherung

Die Vorlesung wird von einem Proseminar (Übungen) begleitet, das ab 20. Oktober 2006 an denselben Freitagen wie die Vorlesung von 14.30 Uhr bis 16 Uhr stattfindet. Die Anmeldung erfolgt in der ersten Vorlesung. Die Teilnahme am Proseminar ist kostenlos.

Bei Bedarf (Anwesenheit nicht deutschsprachiger Teilnehmerinnen oder Teilnehmer) werden die Vorlesung und das Proseminar in englischer Sprache gehalten.