

Seminarankündigung für das SoSe 2011

Versicherungsmathematik

Inhalt:

Das Seminar soll die Inhalte der Vorlesung *Schadenversicherungsmathematik* des WiSe 2010/11 vertiefen und ergänzen. Zu den Schwerpunkten des Seminars zählen u. a.:

- Bonus-Malus-Systeme in der Tarifierung
- Risikomessung und Implementierung von Risikomaßen
- Modellierung und Messung von Abhängigkeiten
- Stochastische Ordnungen für Risiken und Anwendungen
- Credibility Theory
- Verallgemeinerte lineare Modelle

Literatur:

- Embrechts, P., Frey, R., McNeil, A. J.: *Quantitative Risk Management—Concepts, Techniques, Tools*, Princeton University Press, 2005.
- Denuit, M., Dhaene, J., Goovaerts, M., Kaas, R.: *Actuarial Theory for Dependent Risks—Measures, Orders, and Models*, Wiley, 2005.
- Denuit, M., Dhaene, J., Goovaerts, M., Kaas, R.: *Modern Actuarial Risk Theory—Using R*, Springer, 2008.

Zeit:

montags, 18 – 20 Uhr

Vorkenntnisse:

Die Teilnahme am Seminar setzt Basiskenntnisse im Bereich der Stochastik, etwa im Umfang der Vorlesungen *Stochastik I* und *Stochastik II*, voraus. Vorkenntnisse aus der Vorlesung *Schadenversicherungsmathematik* sind hilfreich, jedoch nicht zwingend erforderlich.

Vorbesprechung:

Die Vorbesprechung findet am Mittwoch, dem 9.02.2011, um 14.00 Uhr im Raum F448 statt. Für Fragen zu den Seminarthemen und zur Organisation wenden Sie sich an T. Knispel (Raum F450, knispel@stochastik.uni-hannover.de).