



Einladung zum Mathematischen Kolloquium

Institut für
Mathematik

der Julius-Maximilians-Universität
Würzburg

Dr. Christian Braun

Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft

Modelle in der Schadenreservierung und deren Anwendung in der aktuellen Finanzkrise

Zusammenfassung:

Die Schadenreserven spielen in den Bilanzen von Versicherungsunternehmen eine zentrale Rolle, da sie betragsmäßig eine wesentliche Position der Passivseite darstellen und auf Schätzungen beruhen. Diese Rückstellungen werden mit Hilfe versicherungsmathematischer Schätzverfahren bestimmt.

Im Vortrag wird zunächst die bekannteste Methode zur Ermittlung von Schadenreserven für einzelne Geschäftssegmente und anschließend deren Erweiterung auf das gesamte Portfolio für ein Versicherungsunternehmen vorgestellt.

Die Auswirkungen von ökonomischen Rahmenbedingungen wie zum Beispiel der aktuellen Finanzkrise auf Schadenerwartungen sowie deren Analysemöglichkeiten durch das betrachtete Verfahren werden schließlich an Hand von Modellen erläutert.

Ort: HS 4

Mittwoch, den 8. Juli um 17:00 Uhr

Zu diesem Vortrag laden wir Sie herzlich ein.
Kaffee und Tee ab 16:30 im Sitzungsraum S106 im Mathematikgebäude.

Die Dozenten der Mathematik