

# Bericht aus dem Ausschuss Hochschulausbildung, Aus- und Weiterbildung

Der Ausschuss Hochschulausbildung, Aus- und Weiterbildung (HAW) unter der Leitung von Prof. Stefan Weber setzt sich weiterhin insbesondere mit dem Ausbau des Angebots im Bereich akademischer Weiterbildungen auseinander.

Der Ausschuss hat sich im letzten Quartal intensiv mit den Planungen des dritten Weiterbildungstages der DGVMF befasst. Dieser fand am 16. Juni 2016 zum Thema „Structured and unstructured data – Insurance analytics, products and risk

management of the future“ in den Räumlichkeiten der Hannover Re in Hannover statt. Als Referenten konnte der Ausschuss Dr. Kai Haseloh von der Hannover Re, Wolfgang Hauner von der Munich Re sowie Prof. Dr. Katrien Antonio von der KU Leuven gewinnen. Den Teilnehmern wurde ein abwechslungsreiches Programm geboten, in dem sowohl die zugrunde liegenden mathematischen Theorien erläutert als auch zentrale praktische Fragen beleuchtet wurden. Dabei kamen auch kritische Fragen im

Spannungsfeld zwischen Theorie und Praxis nicht zu kurz.

Im letzten Jahr hat die DAV die Projektgruppe „Ausbildung 2018“ eingerichtet, um das eigene Ausbildungs- und Prüfungssystem einer umfassenden Überprüfung zu unterziehen. Der Ausschuss HAW ist durch Herrn Prof. Weber ebenfalls in dieser Projektgruppe vertreten und ist hier insbesondere für die Berücksichtigung der Sichtweise der Hochschullehrer zuständig.

Prof. Dr. Matthias Scherer

## Konferenz: Dependence Modeling in Finance, Insurance and Environmental Science

Unter diesem Motto fand vom 17. bis 19. Mai 2016 eine internationale Konferenz an der Technischen Universität München statt. Die Modellierung stochastischer Abhängigkeiten ist ohne Zweifel eine Schlüsseldisziplin für das Verständnis von mehrdimensionalen Datensätzen. Dies trifft insbesondere auf die Versicherungswirtschaft zu, in der sowohl in der Prämienkalkulation als auch im Risiko- und Assetmanagement abhängige Zufallsgrößen auftreten. So verwunderte es nicht, dass unter den rund 100 internationalen Teilnehmern aus Wissenschaft und Praxis viele Aktuar und Forscher aus dem Bereich der Versicherungsmathematik zu finden waren.

Auch von den namhaften Hauptreferenten Carole Bernard, Roger Cooke, Fabrizio Durante, Paul Embrechts, Christian Genest, Irène Gijbels, Harry Joe, Luis Mediero, Johanna Nešlehová und Giovanni Puccetti wurden Probleme der Versicherungsmathematik mehrfach fokussiert. So diskutierte



Gruppenfoto vor dem Leibniz-Rechenzentrum in Garching

Fotograf: Andreas Heddergott

Paul Embrechts in seinem Vortrag „Quantile-based risk sharing“, wie im regulatorischen Kontext ein Risiko auf mehrere Agenten optimal verteilt werden kann – unter Berücksichtigung individueller Risikomaße. Roger Cooke kritisierte die „Epizykeln der klassischen Regression“ und warb für eine „Vine Regression“ als Alternative. Christian Genest stellte, basierend auf hierarchischen Copulas, innovative Methoden vor, um Abhängigkeiten in Abwicklungsdreiecken der Schadenaufwendungen

zu modellieren. Neben rund 40 Fachvorträgen fanden unter dem Motto „Verba docent, exempla trahunt“ auch zwei Workshops statt, in denen die Teilnehmer den „Rearrangement Algorithm“ sowie das „r-Package VineCopula“ praktisch kennenlernen durften. Dabei wurden sie von Giovanni Puccetti beziehungsweise von Ulf Schepmeier angeleitet. Organisiert wurde die Konferenz von Claudia Czado, Bettina Haas, Matthias Killiches, Dominik Müller und Matthias Scherer.