



Svenska Aktuarieföreningen

KALLELSE

Medlemsmöte den 3 september 2015

Ämne: Statistiskt beroende och tunga svansar i försäkringsdata

Föredragshållare: Jonas Alm, som disputerade i matematisk statistik vid Chalmers tidigare i år

Tid: Torsdagen den 3 september 2015 kl 17.00

Plats: Ernst & Young, Jakobsbergsgatan 24 Stockholm

Innehåll: I Solvens 2 avgörs solvenskapitalets storlek av fördelningen för ett bolags totala ettårsförlust. Tunga svansar på förlustfördelningar för enskilda försäkringsklasser och beroenden mellan försäkringsklasser påverkar fördelningen för den totala ettårsförlusten och därmed solvenskapitalkravet.

Utgångspunkten för föredraget är en analys av de årliga rapporter innehållande prediktioner om framtida skadeutbetalningar som svenska sakförsäkringsbolag skickat till Finansinspektionen. Ettårsförluster för de olika försäkringsklasserna konstrueras genom att följa bolagens prediktioner från rapport till rapport. Vi undersöker om det finns tecken på tunga svansar i förlustfördelningarna för de enskilda försäkringsklasserna, samt försöker utröna om det finns något statistiskt beroende mellan förluster för olika försäkringsklasser. Resultaten finns publicerade i artikeln "Signs of dependence and heavy tails in non-life insurance data" i Scandinavian Actuarial Journal.

Anmälan:

-Via länken: forening.foreningshuset.se/aktuarieforeningen/loggain

-Vid problem kan anmälan också göras till Noora.Lyly@se.ey.com

-Mötet är kostnadsfritt, efterföljande middag kostar 100 kr för medlemmar. OBS betalning för middagen görs med kort i samband med anmälan på föreningshusets hemsida.

Anmälan görs senast torsdagen den 27:e augusti.

Vänligen var tydlig med om vegetarisk kost önskas (i meddelandefältet i bokningssystemet alternativt via e-post). Anmälan till måltiden är bindande och betalas med kort i samband med bokningstillfället.