



Svenska Aktuarieföreningen

KALLELSE

Medlemsmöte den 26 november 2015

Ämne: Inference in multiplicative pricing

Föredragshållare: Stig Rosenlund, forskare inom matematisk statistik och tidigare aktuarie på Länsförsäkringar

Tid: Torsdagen den 26 november 2015 kl 17.00

Plats: Ernst & Young, Jakobsbergsgatan 24 Stockholm

Tariffanalys syftar till att hitta den bästa uppskattningen av riskpremien (förväntad skadekostnad) för att försäkra ett objekt under ett år. Den vanligaste formen av en tariff är en samling faktorer för olika argument (bakgrundsvariabler). Detta förutsätter en multiplikativ riskpremiestruktur. Två metoder kommer att jämföras, den klassiska MMT (Method of Marginal Totals) och den nyare Standard GLM, där skadeantalen antas Poissonfördelade och skadebeloppen antas vara Gammalfördelade med en konstant variationskoefficient. Aktuariell praxis förutsätter normalt att Standard GLM är att föredra. Men det kommer att visas att av robusthetsskäl är MMT att föredra med tillräckligt många skador eller tillräckligt många argument. Detta beror på att riskpremiemultiplikativitet nästan aldrig kan vara sann med mer än ett argument. Vidare beskrivs den nya variansskattningsmetoden MVW för MMT, som förutsätter svagare antaganden än Standard GLM.

Stig berättar också om sin Indonesienresa kopplad till ämnet ovan under november 2014 och visar några bilder.

Anmälan:

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

-Vid problem kan anmälan också göras till john.brandel@se.ey.com

-Mötet är kostnadsfritt, efterföljande middag kostar 100 kr. OBS, på grund av tekniska skäl fungerar inte kortbetalning denna gång – middagen betalas kontant på plats. Vänligen ange om du vill ha middag vid anmälan.

Anmälan görs senast måndagen den 23:e september.

Vänligen var tydlig med om vegetarisk kost önskas (i meddelandefältet i bokningssystemet alternativt via e-post).