



Pressemitteilung

Köln, 29. April 2020

GAUSS-Preis und GAUSS-Nachwuchspreise für herausragende Arbeiten verliehen

Die Deutsche Gesellschaft für Versicherungs- und Finanzmathematik e.V. (DGVFM) und die Deutsche Aktuarvereinigung e.V. (DAV) haben den renommierten GAUSS-Preis und drei GAUSS-Nachwuchspreise für herausragende wissenschaftliche Arbeiten aus der Versicherungs- und Finanzmathematik verliehen. Das hochrangige Expertengremium aus Wissenschaft und Praxis kürt mit den Preisen Facharbeiten, die eine Brücke zwischen wissenschaftlicher Qualität und hoher Praxisrelevanz schlagen.

Neu seit diesem Jahr ist das Auswahlverfahren des GAUSS-Preises: Die Fachjury ermittelt den oder die Preisträger*in des Hauptpreises fortan aus allen veröffentlichten Fachartikeln im European Actuarial Journal (EAJ) eines Erscheinungsjahres.

Mit dem diesjährigen GAUSS-Preis (dotiert mit 3.000 Euro) ausgezeichnet wird Christian Furrer von der Universität Kopenhagen für seine Arbeit *„Experience rating in the classic Markov chain life insurance setting. An empirical Bayes and multivariate frailty approach“*. „Christian Furrers Paper stellt einen neuen Ansatz zur Beurteilung des Kleinerwerdens von Kollektiven in der Lebensversicherung vor“, so die Jury bei der Bewertung der Arbeit. „Bemerkenswert und preiswürdig hierbei ist sein Ansatz, die Veränderung des Kollektivs in Sprüngen zu beschreiben, was – im Gegensatz zu einer gleichmäßigen Schrumpfung – die Realität genauer abbildet.“

GAUSS-Nachwuchspreise – ausgezeichnete Abschlussarbeiten

Dorothee Westphal von der Technischen Universität Kaiserslautern erhält für ihre Dissertation *„Model Uncertainty and Expert Opinions in Continuous-Time Financial Markets“*, die sich mit den Problemen der Modellsicherheit auf Finanzmärkten beschäftigt, einen der drei GAUSS-Nachwuchspreise. „Die verwendete Theorie der robusten Portfoliooptimierung ist ein sehr aktuelles Thema – Ökonomen haben schon länger auf die Wichtigkeit dieses Aspekts hingewiesen“, führt Juryvorsitzender Prof. Dr. Alfred

Müller aus. „Dorothee Westphal gelingt es in ihrer Arbeit, unter realitätsnahen Annahmen explizite Lösungen für dieses schwierige Problem zu finden.“

Auch Stefan Schelling von der Universität Ulm wird mit einem GAUSS-Nachwuchspreis für seine Dissertation „*Behavioral Aspects of Product Design and Demand in Retirement Savings*“ ausgezeichnet. In dieser wird unter anderem der Frage nachgegangen, warum Lebensversicherungs-/Ansparprodukte auf dem Lebensversicherungsmarkt erfolgreich sind, die eigentlich aus Sicht der Erwartungsnutzen-Theorie und der kumulativen Prospekt-Theorie suboptimal sind. „Die Arbeit behandelt sehr sorgfältig eine realitätsnahe Modellierung praktisch relevanter Fragestellungen und behandelt versicherungsmathematische Themen von großer praktischer Bedeutung“, betont die Jury des GAUSS-Nachwuchspreises.

„Eine große Stärke der Arbeit ist der Praxisbezug – insbesondere zum Thema Solvency II“, lobt Prof. Dr. Müller die Doktorarbeit von Lukas Hahn von der Universität Ulm, für die der dritte GAUSS-Nachwuchspreis verliehen wird. Die Arbeit „*Quantative Assessment of Multi-Year Non-Life Insurance Risk*“ beschäftigt sich mit der Schätzung der Streuung für die Reserveschätzverfahren „Chain-Ladder“ und „additives Modell“. Dabei werden bekannte Verfahren mit neuen Aspekten kombiniert, um so zu einer verbesserten quantitativen Bewertung des mehrjährigen Risikos in der Schaden- und Unfallversicherung zu gelangen.

Digitale Präsentation der ausgezeichneten Arbeiten

Aufgrund der Absage der DAV/DGVFM-Jahrestagung, auf der die Verleihung der Preise üblicherweise stattfindet, werden im Rahmen der e-Jahrestagung auf www.actuview.com digitale Präsentationen der ausgezeichneten Arbeiten angeboten. Ab dem 30. April 2020 stehen die Aufzeichnungen der Preisträger zur Verfügung.

Ausschreibungsbeginn für den GAUSS-Nachwuchspreis 2020

Für das Jahr 2020 werden wieder bis zu drei GAUSS-Nachwuchspreise (dotiert mit jeweils 2.000 Euro) vergeben. Ab Sommer 2020 können Abschlussarbeiten (Master/ Promotion) zu wissenschaftlichen und praxisrelevanten Themen aus den Finanz- und Aktuarwissenschaften eingereicht werden.