

Sprawozdanie z konferencji

Sprawozdanie z XI Ogólnopolskiej Konferencji Naukowej „Zagadnienia aktuarialne – teoria i praktyka”, Wrocław, 19–21 września 2016 r.

W dniach 19–21 września 2016 r. odbyła się XI Ogólnopolska Konferencja Naukowa „Zagadnienia aktuarialne – teoria i praktyka”. Konferencje z tego cyklu organizowane są od ponad dziesięciu lat na przemian przez: Katedrę Statystyki Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, Instytut Matematyczny Uniwersytetu Wrocławskiego, Kolegium Analiz Ekonomicznych Szkoły Głównej Handlowej w Warszawie, Wydział Nauk Ekonomicznych Uniwersytetu Warszawskiego i Centrum Zastosowań Matematyki Instytutu Matematycznego Polskiej Akademii Nauk. W tym roku konferencja organizowana była przez placówki wrocławskie: Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu oraz Uniwersytet Wrocławski.

Patronat honorowy nad konferencją objęli prof. dr hab. Andrzej Kaleta, rektor Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, oraz Polska Izba Ubezpieczeń. Patronat merytoryczny nad konferencją sprawowało Polskie Stowarzyszenie Aktuariuszy. Elżbieta Wanat-Połeć, prezes Ubezpieczeniowego Funduszu Gwarancyjnego, objęła patronatem sesję poświęconą ubezpieczeniom komunikacyjnym. Patronat medialny sprawowały: „Rozprawy Ubezpieczeniowe”, „Gazeta Ubezpieczeniowa”, „Dziennik Ubezpieczeniowy” oraz „Miesięcznik Ubezpieczeniowy”.

Od lat w konferencji uczestniczą zarówno pracownicy naukowcy o dużym dorobku naukowym i wielkim doświadczeniu, pracownicy naukowcy dopiero rozpoczynający karierę naukową oraz ci, którzy już wspinają się po kolejnych jej szczeblach, jak również doświadczeni profesjonalści ze środowiska praktyki aktuarialnej¹. Spotkania charakteryzują się wysokim poziomem przygotowanych na tę okazję odczytów. W tym roku wygłoszonych zostało ponad dwadzieścia referatów o tematyce dotyczącej zagadnień statystyki aktuarialnej i jej zastosowań. Odbyło się siedem sesji tematycznych, podzielonych na zagadnienia dotyczące teorii ruiny i ryzyka ubezpieczeniowego, ubezpieczeń komunikacyjnych oraz umów wieloosobowych. Ponadto uczestnicy konferencji wysłuchali cyklu referatów dotyczących zagadnień finansowych i śmiertelności. Każdego dnia sesje poprzedzone były referatami plenarnymi. Tematyka prezentowanych wyników badań naukowych z dziedziny ubezpieczeń komunikacyjnych obejmowała przede wszystkim systemy bonus-malus, wielowymiarowe rozkłady liczby szkód, reguły przejścia, a także aspekt lojalności klientów. Poruszano także kwestię wpływu rozwoju technologii informatycznych na rynek ubezpieczeń. Dużą popularnością cieszyły się tematy dotyczące prawdopodobieństwa ruiny, przełącznikowego oraz wieloklasowego modelu ryzyka, modelu zależnego ryzyka, rezerw szkodowych, rozkładu strat, procesu spadku i wzrostu, procesu fazowego, optymalizacji kontraktów ubezpie-

¹ Pełna lista uczestników, streszczenia referatów i program konferencji znajdują się na stronie <http://oka.ue.wroc.pl>.

zeniowych oraz kontraktów z paryską dywidendą. Poruszana była także problematyka modelowania struktury zależności w ubezpieczeniach wieloosobowych, w których na szczególną uwagę zasługuje zastosowanie funkcji *copula* do modelowania struktury probabilistycznej w małżeńskich ubezpieczeniach życiowych oraz małżeńskich rentach hipotecznych.

W tym roku bardzo dostrzegalna była współpraca naukowa tak wewnątrzuczelniana, jak i między poszczególnymi ośrodkami naukowymi. Kilka referatów wygłoszonych zostało w ramach projektów badawczych finansowanych przez Narodowe Centrum Nauki.

Stałym elementem konferencji jest konkurs na najlepszy referat wygłoszony przez młodego uczestnika. Kapitułę konkursu stanowili obecni członkowie Komitetu Programowego pod przewodnictwem prof. dr. hab. Tomasza Rolskiego. Członkowie kapituły, wyłaniając laureata, wzięli pod uwagę wyniki ankiety przeprowadzonej wśród uczestników konferencji, a także własne spostrzeżenia i opinie. Z uwagi na to, że wygłoszone referaty były na wysokim poziomie, wybór zwycięzcy był bardzo trudny. Główną nagrodę, ufundowaną przez Elżbietę Wanat-Połeć, w wysokości 3000 zł netto, otrzymała dr **Elżbieta Krajewska** z Instytutu Matematyki Politechniki Łódzkiej za referat zatytułowany „Immunizacja portfela częściowo replikowalnego”. Przyznano również dwa wyróżnienia. Pierwsze otrzymał mgr **Michał Krawiec**, doktorant w Instytucie Matematycznym Uniwersytetu Wrocławskiego, który wygłosił referat „Detekcja zmiany dryfu w modelowaniu natężenia śmiertelności”. Drugie wyróżnienie za referat „Wpływ struktury probabilistycznej na wysokość świadczeń małżeńskiej renty hipotecznej”, otrzymała dr inż. **Agnieszka Marciniuk**, adiunkt w Katedrze Statystyki Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu.

Tegoroczne spotkanie było wyjątkowe, bowiem zostało zadedykowane Profesorowi Tomaszowi Rolskiemu z okazji siedemdziesiątej rocznicy urodzin.

Agnieszka Marciniuk