

Einladung zu einer Vorlesung über Bewertung von Optionen und Garantien in der Lebensversicherung

am 8. und 9. Juni 2018
an der Universität Salzburg

- Vortragender: Dipl.-Ing. René Knapp
Leiter Konzern-Aktuariat und Konzern-Risikomanagement
UNIQA Insurance Group, Wien
Aktuar AVÖ
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine: Freitag, 8. Juni 2018, 13–19 Uhr
Samstag, 9. Juni 2018, 9–15 Uhr
- Inhalt: Unter Heranziehung von Methoden der modernen Finanzmathematik werden Verfahren zur Bewertung von Optionen und Garantien in der Lebensversicherung vorgestellt. Neben dem Aufbau eines entsprechenden Modells zur Bewertung werden auch damit verbundene und notwendige Systeme (Simulationsmodelle, Economic Scenario Generator) sowie die erforderliche Validierung behandelt.
- Die Vorlesung versteht sich als Angebot zur beruflichen Weiterbildung (CPD) im Umfang von 10 Stunden. Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter (§§ 114 – 116 VAG), zum Leiter der versicherungsmathematischen Funktion oder dessen Stellvertreter (§ 113 VAG) sowie zum Leiter der Risikomanagement-Funktion oder dessen Stellvertreter (§ 112 VAG). Grundkenntnisse der Finanzmathematik sind von großem Nutzen. Die Gliederung der Vorlesung finden Sie nachstehend.
- Kostenbeitrag: € 216 (inkl. USt.) ohne Hotelunterkunft, € 348 (inkl. USt.) mit Unterkunft von Freitag auf Samstag im Arcotel Castellani einschließlich Frühstücksbuffet. Die Kaffeepausen sind in beiden Beträgen inbegriffen. Aufpreis für

eine weitere Nächtigung von Samstag auf Sonntag € 100 (inkl. USt.), Aufpreis für eine Begleitperson (Unterbringung im Hotelzimmer der Teilnehmerin bzw. des Teilnehmers einschließlich Frühstücksbuffet) € 25 (inkl. USt.) pro Nacht. Für den Aufpreis wird auf Wunsch eine separate Rechnung ausgestellt.

Auskünfte: Für weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Frau Sarah Lederer per E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at). Bitte fügen Sie Ihre Telefonnummer hinzu. Ihre Fragen werden so bald wie möglich beantwortet.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder per E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at), und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 9. Mai 2018 auf das folgende Konto:

Salzburg Institute of Actuarial Studies (SIAS)
IBAN: AT79 2040 4000 0001 2021 BIC: SBGSAT2S

Ort: Naturwissenschaftliche Fakultät, Hörsaal 402
5020 Salzburg, Hellbrunner Straße 34

Gliederung der Vorlesung

1 Modellierung von Garantien in der Lebensversicherung

- a. Motivation und Bedeutung der Problemstellung
- b. Aufbau eines Bewertungsmodells
- c. Validierung der Ergebnisse (Martingal-Test, Leakage-Test)
- d. Tools und Systeme in der Praxis

2 Kapitalmarktmodelle zur Bewertung von eingebetteten Optionen und Garantien

- a. Modellierung von Zinsstrukturkurven
- b. Aufbau eines Economic Scenario Generator (ESG)
- c. Validierung von Kapitalmarktszenarien
- d. Tools und Systeme in der Praxis

Die Vorlesung wird in deutscher Sprache gehalten.