

Einladung
zu einer Vorlesung über Aktuarielle Modellierung
mit besonderer Berücksichtigung von Solvency II

von 30. September 2015 bis 3. Oktober 2015
an der Universität Salzburg

- Vortragende: Dipl.-Math. Dr. Nora Gürtler
Chief Risk Officer
Generali Deutschland Holding AG, Köln
Gastprofessorin an der Universität Salzburg
- Dipl.-Ing. Dr. Markus Orasch
Senior Consultant
Towers Watson, Köln
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine: Mittwoch, 30. September 2015, 9.00 – 17.30 Uhr
Donnerstag, 1. Oktober 2015, 9.00 – 17.30 Uhr
Freitag, 2. Oktober 2015, 9.00 – 17.30 Uhr
Samstag, 3. Oktober 2015, 9.00 – 12.30 Uhr
- Inhalt: Neben der grundlegenden Definition und Einordnung des Modellbegriffs und des Modellierungsprozesses wird ein Überblick über die Anwendung von Modellen im Versicherungsbereich vermittelt. Schwerpunkte sind die Funktion, Auswahl, Kalibrierung und kritische Beurteilung von Modellen in der unternehmerischen Praxis. Ein spezieller Fokus wird dabei auf dem Einsatz von Modellen im Kontext von Solvency II liegen.
- Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse der Aktuariellen Modellierung, die nach den Richtlinien der Aktuarvereinigung Österreichs (<http://www.sias.at/avoe>) Voraussetzung für die Anerkennung als Aktuar sind und den Anforderungen der Deutschen Aktuarvereinigung entsprechen (<http://www.sias.at/dav>). Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter gemäß § 115 VAG 2016. Als Weiterbildungsveranstaltung (CPD) ist die Vorlesung im Umfang von 21 Stunden anrechenbar. Die Einladung zur Teilnahme richtet sich ausdrücklich auch an erfahrene Praktiker. Grundkenntnisse der Versicherungsmathematik werden vorausgesetzt. Die Gliederung der Vorlesung finden Sie auf der Rückseite.
- Kostenbeitrag: € 594 (inkl. USt.) ohne Hotelunterkunft, € 954 (inkl. USt.) mit Unterkunft von Dienstag bis Samstag (4 Nächtingungen) im Parkhotel Castellani einschließlich Frühstücksbuffet. Die Mittagessen und die Kaffeepausen sind in beiden Beträgen inbegriffen.
- 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.

Bitte wenden.

Anmeldung: Bitte schicken Sie das beiliegende Anmeldeformular per Post oder per E-Mail (sarah.lederer@sbg.ac.at), oder faxen Sie es an 0662-8044-155, und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 28. August 2015 auf das folgende Konto. Nach diesem Stichtag ist eine Anmeldung mit Hotelunterkunft nur auf Anfrage möglich. Für Teilnehmerinnen und Teilnehmer, die keine Hotelunterkunft benötigen, können Anmeldung und Überweisung bis 11. September 2015 erfolgen.

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 Grundlagen der Modellierung

- a. Definition des Modellbegriffs und Komponenten eines Modells
- b. Der Modellierungsprozess
- c. Grundzüge von Solvency II

2 Modelle in der Lebensversicherung

- a. Profit Test
- b. Übergang vom einzelvertraglichen Profit Test zur Bestandsmodellierung (Komponenten, Strukturen, Anwendungsmöglichkeiten)
 - Grundlegende Struktur eines Passivmodells
 - Aggregation/Modellpunkte
- c. Anwendungsmöglichkeiten eines Passivmodells (z. B. Embedded Value, GuV- und Bilanzplanung, Bewertung von Versicherungsbeständen)
- d. Verständnis der Grundkonzepte eines Aktiv/Passivmodells
 - Grundkonzepte
 - Unternehmens-, Szenarien-, Aktiv- und Strategiemodelle
- e. Anwendungsmöglichkeiten des Unternehmensmodells
- f. Standard- und Internes Modell im Kontext von Solvency II für Lebensversicherungen

3 Modelle in der Kompositversicherung

- a. Konzeptionelle Einordnung und Diskussion verschiedener Modelle in der Kompositversicherung
 - Individuelles und kollektives Modell der Risikotheorie zur Modellierung von Schäden
 - Beispiele für Modelle in der Kompositversicherung
- b. Modelle für Unternehmensplanung und -bewertung
- c. Grundsätzlicher Überblick der Komponenten eines Unternehmensmodells für Dynamische Finanz-Analyse (DFA)
 - Grundkonzepte eines Aktiv/Passivmodells
 - Stochastische Modellierung von (Brutto-)Schäden (Basisschäden, Großschäden, Naturkatastrophen) sowie Validierung und Plausibilisierung
 - Rückversicherungs-, Abwicklungs- und Auswertungsmodelle
 - Reserverisiko
 - Modellierung von Abhängigkeiten
- d. Anwendungen eines DFA-Modells
- e. Standard- und Internes Modell im Kontext von Solvency II für Kompositversicherungen

Bei Bedarf (Anwesenheit nicht deutschsprachiger Teilnehmerinnen oder Teilnehmer) wird die Vorlesung in englischer Sprache gehalten.