

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

von 26. bis 29. September 2012  
an der Universität Salzburg

- Vortragende: Dipl.-Math. Dr. Nora Gürtler  
Leiterin Enterprise Risk Management  
Generali Deutschland Holding AG, Köln  
Gastprofessorin an der Universität Salzburg
- Dipl.-Math. Frank Schepers  
Managing Director  
Towers Watson, Köln  
Gastprofessor an der Universität Salzburg
- Termine: Mittwoch, 26. September, 9.00 – 17.30 Uhr  
Donnerstag, 27. September, 9.00 – 17.30 Uhr  
Freitag, 28. September, 9.00 – 17.30 Uhr  
Samstag, 29. September, 9.00 – 12.30 Uhr
- Inhalt: Die Vorlesung vermittelt jene Kenntnisse der Aktuariellen Modellierung, die nach den neuen 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/day>). Die Vorlesung eignet sich auch zur Erfüllung der Anforderungen der österreichischen Finanzmarktaufsicht für die Bestellung zum verantwortlichen Aktuar oder dessen Stellvertreter gemäß § 24 VAG. Als Weiterbildungsveranstaltung (CPD) ist die Vorlesung im Umfang von 21 Stunden anrechenbar. 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 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: € 498 ohne Hotelunterkunft, € 858 mit Unterkunft von Dienstag bis Samstag (4 Nächtigungen) im Parkhotel Castellani einschließlich Frühstücksbuffet. Die Mittagessen und die Kaffeepausen sind für alle Teilnehmer inbegriffen.
- Auskünfte: Für weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Frau Sarah Lederer per E-Mail ([sarah.lederer@sbg.ac.at](mailto: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](mailto:sarah.lederer@sbg.ac.at)), oder faxen Sie es an 0662-8044-155, und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 24. August 2012 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 7. September 2012 erfolgen.

Salzburg Institute of Actuarial Studies (SIAS)  
IBAN: AT 792 040 400 000 012 021 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)
- c. Anwendungsmöglichkeiten eines Passivmodells (z. B. Embedded Value, GuV- und Bilanzplanung, Bewertung von Versicherungsbeständen)
- d. Verständnis der Grundkonzepte eines Aktiv/Passivmodells
- 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
  - Rückversicherungsmodell
  - Reserverisiko
  - Modellierung von Abhängigkeiten
  - Abwicklungsmodell
  - Auswertungsmodell
- d. Anwendungen eines DFA-Modells
- e. Standard- und Internes Modell im Kontext von Solvency II für Schaden/Unfallversicherungen

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