

## **Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik**

# **Dynamische Finanzanalyse und Asset-Liability-Management**

Halbtages-Seminar unterstützt von der Schweizer Rück

Komplexer werdende Anforderungen aufgrund angepasster Rechnungslegungsvorschriften und wachsende Ansprüche seitens der Aufsichtsbehörden haben die Dynamische Finanzanalyse (DFA) in letzter Zeit vermehrt in den Fokus der Versicherungsgesellschaften gerückt. Anhand konkreter Beispiele vermitteln die Experten von Swiss Re einen Überblick über die Anwendung von DFA-Konzepten in der Praxis.

### **Sprecher:**

**Dr. Claude Schwarz**, Life & Health

**Dr. Peter Sohre**, Financial Services

### **Ansprechpartner/Diskussionsteilnehmer:**

Vertreter des Account Managements Life & Health sowie P/C (Property-Casualty)

**Termin:** Dienstag, **1. Oktober 2002**, 14:00 Uhr bis ca. 17:30 Uhr

**Ort:** **Technische Universität Wien**  
A-1060 Wien, Getreidemarkt 9  
Maschinenbaugebäude, Hoftrakt, Stiege IV, 2. Obergeschoss  
GM 4 Knoller Hörsaal

### **Programm:**

1. Begrüßung
2. Dynamische Finanzanalyse (DFA)/Asset-Liability-Management (ALM)
  - Woher kommt ALM?
  - Was ist DFA und ALM?
  - Wo steht die Entwicklung heute?
3. Einsatz von DFA in der Praxis (Nicht-Leben)
  - Strategisches Risikomanagement
  - Risikokapital
  - Value Based Management
  - Strategische Asset Allokation
4. Einsatz von DFA in der Praxis (Leben)
  - Bestimmung einer adäquaten Überschusspolitik
  - Evaluation von alternativen Anlagen-Mixes
5. Diskussion/Schlusswort

Direktor Helmut Holzer  
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs  
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins  
der Versicherungsmathematik

Gen.-Dir. Dr. Siegfried Sellitsch  
Präsident der Österr. Gesellschaft  
für Versicherungsfachwissen

o.Univ.-Prof. Dr. W. Schachermayer  
Institut für Finanz- und Versicherungsmathematik  
Technische Universität Wien