

Seminareinladung

Donnerstag, 10. Dezember 2009

Thema :

„Stochastische Simulationen in der Lebensversicherung “

Beginn : 12:30 Uhr und endet um 18:00 Uhr.

Ort : Hotel Rathauspark, 1010 Wien, Rathausstraße 17

Seminargebühr : (inkl. Mittagessen und Pausengetränke)

AVÖ –Mitglieder € 300,- inkl. USt.

Nicht-Mitglieder € 360,- inkl. USt.

Studenten (AVÖ –Mitglieder) € 240,- inkl. USt.

Studenten (nicht –Mitglieder) € 300,- inkl. USt.

Als Studenten können nur Personen ohne Berufstätigkeit anerkannt werden.

Im Anschluss an das Seminar lädt die PartnerRe Sie gerne zu einem Abendessen ein.

Inhalt :

Dipl.-Ing. Peter Prieler – Generalsekretär der AVÖ
Begrüßung und Einleitung

Dr. Reinhold KAINHOFER – TU Wien (Inst. Wirtschaftsmath., Finanz-&Vers.Math.)
Aktuelle Entwicklungen bei stochastischen Modellen in der Lebensversicherung

Dr. Stefan GASSER – PartnerRe
Die Abbildung des biometrischen Risikos in internen Modellen zu Solvency II

Claude CHÈVRE – PartnerRe
Praktische Anwendungen von stochastischen Simulationen in der Lebensversicherung
Exzedentenrückversicherung ohne Volatilitätsreduktion – ein Paradox?

Dieses Seminar entspricht 4 Stunden und sie erhalten 4 CPD Punkte der AVÖ.

Seminar über stochastische Simulationen in der Lebensversicherung

Vortragende: Dr. Reinhold Kainhofer, Dr. Stefan Gasser, Claude Chèvre

Stochastische Verfahren und Modelle können in der Lebensversicherung nicht nur zur Risiko-Analyse und -Steuerung der Kapitalanlagen eingesetzt werden, sondern auch für die interne Risikoevaluierung der Biometrie. Insbesondere bei risikoadäquaten Modellierungen des Solvenzkapitals im Rahmen von Solvency II ist das Verständnis der unterliegenden Volatilität von grosser Bedeutung. Dabei können direkte praktische Anwendungen stochastischer Simulationen zum Entscheidungsprozess beitragen, beispielsweise bei der Analyse von Stressszenarien, aber auch im Portfolio-Management vor und nach Rückversicherung.

Im Seminar wird ein Überblick zur Anwendung von Stochastik in der Lebensversicherung gegeben und aktuelle Entwicklungen stochastisch basierter Modelle vorgestellt. Auf Basis von Beispielen wird die Risikosituation biometrischer Lebensversicherungs-Portefeuilles untersucht und die Konsequenzen diverser Einfluss-Faktoren aufgezeigt.

Die Teilnehmer sollten ein Grundwissen in Wahrscheinlichkeitsrechnung mitbringen und Interesse an der Analyse und Management der biometrischen Risikosituation von Lebensversicherungs-Portefeuilles haben.

Agenda

- 12:30 – 13:30 Uhr: Begrüssung und Lunch
- 13:30 – 15:00 Uhr: Aktuelle Entwicklungen bei stochastischen Modellen in der Lebensversicherung,
Dr. Kainhofer
- 15:00 – 16:00 Uhr: Abbildung des biometrischen Risikos in internen Modellen zu Solvency II,
Dr. Stefan Gasser
- 16:00 – 16:30 Uhr: Kaffeepause
- 16:30 – 18:00 Uhr: Exzedentenrückversicherung ohne Volatilitätsreduktion – ein Paradox?,
Praktische Anwendungen von stochastischen Simulationen in der Lebensversicherung,
Claude Chèvre
- ab 18:30 Uhr: Abendessen auf Einladung der PartnerRe

Bitte bis spätestens **03. Dezember 2009** zurücksenden an :

ÖFdv – Sekretariat - Helga Prieler
A - 7002 Eisenstadt , Postfach 1
FAX : +43 / (0)2682 / 72794-0

Seminar - Anmeldung

„Stochastische Simulationen in der Lebensversicherung “

Donnerstag, 10. Dezember 2009 – von 12:30 Uhr bis 18:00

Ort : Hotel Rathauspark, 1010 Wien, Rathausstraße 17

Die Rechnung über den Seminarbeitrag wird Ihnen umgehend übermittelt und ist sofort fällig.

Name

Vorname

Titel

Firma (wenn Rechnungslegung
an Firma erwünscht)

Straße

PLZ – Ort

Email Adresse

Ich melde mich für dieses Seminar des ÖFdv am Donnerstag, 10. Dezember 2009 verbindlich an.

Ich bleibe gerne auch zum Abendessen

Leider kann ich nicht zum Abendessen bleiben

.....
Datum

.....
Unterschrift

Österreichischer Förderungsverein der Versicherungsmathematik (ÖFdv)

www.avoe.at

Postanschrift : Postfach 1 , A-7002 Eisenstadt

sekretariat@avoe.at

Bankverbindung : RaiffeisenBank Wien , BLZ 32000 , Konto-Nr. 1.915.909

UID : ATU 51251103

IBAN : AT82320000001915909 BIC : RLNWATWW

ZVR-Zahl: 186481183