

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

von 26. bis 29. September 2018  
an der Universität Salzburg

Vortragende: Dipl.-Math. Dr. Nora Gürtler  
Head of Group Audit  
Assicurazioni Generali S.p.A., Mailand  
Gastprofessorin an der Universität Salzburg

Dipl.-Ing. Dr. Markus Orasch  
Leiter Insurance Consulting and Technology Österreich  
Willis Towers Watson, Köln  
Gastprofessor an der Universität Salzburg

Termine: Mittwoch, 26. September 2018, 9.00 – 17.30 Uhr  
Donnerstag, 27. September 2018, 9.00 – 17.30 Uhr  
Freitag, 28. September 2018, 9.00 – 17.30 Uhr  
Samstag, 29. September 2018, 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 und aktuellen Themen wie PRIIPs 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/day>). 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). 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 folgenden Seite.

Kostenbeitrag: € 666 (inkl. USt.) ohne Hotelunterkunft, € 1.138 (inkl. USt.) mit Unterkunft von Dienstag bis Samstag (4 Nächtingungen) in einem 4-Sterne-Hotel 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.leederer@sbg.ac.at](mailto:sarah.leederer@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.leederer@sbg.ac.at](mailto:sarah.leederer@sbg.ac.at)), und überweisen Sie bitte den Kostenbeitrag bis 24. August 2018 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 2018 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. Packaged Retail and Insurance-based Investment Products (PRIIPs)
- g. 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 Schadenmodellierung
  - 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.