

Thema: Rückversicherungs-Pricing von Stop Loss und aggregate XL

Beschreibung: Seminarleiter Prof. Dr. Michael Fröhlich zu den Inhalten:
Diese 2-tägige Weiterbildungsveranstaltung richtet sich an Mathematiker und Aktuare, die Kontakt mit dem Pricing in der nonlife Rückversicherung haben oder sich in diesem Bereich weiterbilden möchten und insbesondere aktuelle Forschungsergebnisse erfahren möchten über Stop Loss und aggregate XL Pricing. Die aktuarielle Bewertung eines Stop Loss gilt als Königsdisziplin des RV-Pricing und erfordert sowohl umfangreiche Pricing-erfahrung als auch die mathematische Fähigkeit, einen richtigen Modellansatz zu wählen und anschließend die Modellergebnisse zu plausibilisieren und korrekt zu interpretieren.

Das Weiterbildungsseminar gibt am 1. Tag einen Überblick der plausiblen aktuariellen Pricingmethoden für Hagel Stop Loss und am 2. Tag allgemein für aggregate XLs anhand vieler Quotierungsbeispiele und präsentiert aktuelle Forschungsergebnisse. Die Seminare sind einzeln buchbar!

Die Lerninhalte werden vornehmlich anhand grafisch aufbereiteter Beispiele aus der Rückversicherungspraxis dargestellt. Ein wesentlicher Bestandteil dieses Seminars ist die konkrete Umsetzung der theoretischen Inhalte in Form von Praxisbeispielen aus der Rückversicherung. Das Seminar ist daher teilweise als Workshop ausgelegt. Neben den Vorträgen findet sich Zeit für Diskussionen und praktische Übungen.

Somit lernen die Seminarteilnehmer die Anwendung unterschiedlicher Ansätze zur technischen Bewertung eines Stop Loss und die korrekte Interpretation der Modellresultate.

Kenntnisse der üblichen mathematisch-statistischen Inhalte des Universitäts- bzw. Hochschulstoffs sind von Vorteil.

Zur optimalen Bearbeitung der Übungsaufgaben wäre Laptop mit Excel erforderlich.

Folgend eine Übersicht über die geplanten Inhalte des Seminars:

- Definition und Wirkungsweise eines Stop Loss / aggregate XL Vertrags
- Benötigte Daten und Adjustierung für Bewertung von SL und agg. XL
- Verschiedene Quotierungsmodelle und Verteilungsannahmen
- Quotierungsbeispiele von Hagel Stop Loss und aggregate XLs
- Reinstatement Premium Protection, Frequenz Cover, med mal Stop Loss
- Übungsaufgaben mit Laptop und Excel
- Tipps und Tricks fürs Stop Loss / aggregate XL Pricing und Blick über den Tellerrand. Ausgefallene Verträge mit Quotierungsansätzen

Termin: 07./08.03.2019
Weiterbildung: Entspricht 12,5 Netto-Weiterbildungsstunden
Kosten: 720,00 €/820,00 € zzgl. MWSt. (Mitglieder / Nicht-Mitglieder)
Ort: Köln