

Projekt PL0435 *Wzmocnienie zdolności administracyjnych i instytucjonalnych Urzędu Komisji Nadzoru Finansowego w zakresie prawidłowego wprowadzania w życie dorobku prawnego Wspólnoty w obszarze rynku finansowego*

Szkolenie – moduł II

Modele wewnętrzne zakładów ubezpieczeń i ubezpieczeniowych grup kapitałowych w ramach Dyrektywy Wyplacalność II. Praktyczne aspekty weryfikacji spełnienia przez model wewnętrzny standardów statystycznych (jakości danych).

24 sierpnia 2010, Warszawa

Szczegółowy program

Godzina	Prowadzący	Temat
9.00-10.30	Philipp Keller	Metody Monte Carlo Metody wykorzystywane do obliczeń prognozy rozkładu prawdopodobieństwa Sprawdzenie jakości danych
10.30-10.45		Przerwa
10.45-12.15	Philipp Keller	Ryzyka na ogonie rozkładu
12.15-13.00		Lunch
13.00-14.00	Andrew Smith	Metoda LSLE (least solvent likely event) and MLRE (most likely ruin event): <ul style="list-style-type: none"> Mocne i słabe punkty Wykorzystanie metod LSLE i MLRE Ekstrapolacja i ocena ekspercka Miary wypukłości oraz efekty nieliniowości
14.00-14.45		Przerwa
14.45-17.00	Andrew Smith	Przykład 2A1 – Przykład wyliczenia według metod LSLE i MLRE Przykład 2B2 – Przykład technik ograniczania ryzyka