

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 V

Modelowanie działalności zakładu ubezpieczeń.

23 sierpnia 2010, Warszawa

Szczegółowy program

Godzina	Prowadzący	Temat
9.00-10.30	Philipp Keller	<p>Modelowanie grup ubezpieczeniowych oraz kapitału oraz instrumentów transferu ryzyka</p> <p>Wycena oparta na zasadach rynkowych (Market consistent valuation) oraz margines ryzyka</p> <ul style="list-style-type: none"> • Metody obliczenia marginesu ryzyka • Alokacja marginesu ryzyka
10.30-10.45		Przerwa
10.45-12.30	Philipp Keller, Andrew Smith	<p>Techniczne aspekty modelowania ubezpieczeń majątkowych:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ryzyko jednoroczne oraz przepływ informacji, przykłady pomiaru ryzyka jednorocznego • Uwzględnienie inflacji (superimposed) • Korekty danych historycznych i ekstrapolacja, dopasowanie rozkładów • Modelowanie zdarzeń rzadkich (NatCat) włączając wykorzystanie modeli zewnętrznych • Identyfikacja zależności • Modelowanie reasekuracji <p>Techniczne aspekty modelowania ubezpieczeń na życie:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Prognozy neutralne ze względu na ryzyko (Risk neutral) oraz rzeczywiste (real world) • Generatory scenariuszy ekonomicznych – modele zewnętrzne: The Smith Model, Barrie & Hibbert, Algorithmics • Ekstrapolowanie cen rynkowych • Modelowanie zachowań ubezpieczonych • Połączenie stresów ryzyka rynkowego i szukanie VaR
12.30-13.15		Lunch
13.15-15.15	Andrew Smith	Techniczne aspekty modelowania ubezpieczeń na życie (c.d.)
15.15-15.30		Przerwa

15.30-17.00	Andrew Smith	Techniczne aspekty modelowania ubezpieczeń na życie (c.d.) Oprogramowania do modelowania przepływów pieniężnych i działalności zakładów ubezpieczeń: najlepsze praktyki i pułapki Excela Przykładowe wyliczenia: dynamiczne i stochastyczne modelowanie, generowane raporty, sprawdzenie wyników
-------------	--------------	--