

Vorlesungsankündigung für das SS 2010

**Quantitative Methoden zur Steuerung von
Versicherungsunternehmen**

TV 2 Di 8.00 - 10.00 Uhr F 428

Inhalt:

Mathematische Methoden spielen in der Versicherungswirtschaft nicht nur in den klassischen aktuariellen Bereichen wie Risikomanagement und Versicherungstechnik eine wichtige Rolle, sondern zunehmend auch in der wertorientierten Steuerung. In dieser Vorlesung beschäftigen wir uns nach einer kurzen Einführung in die Methoden zur Bestimmung des Risikokapitals unter Solvency 2 mit der "optimalen" Verwendung des Kapitals. Im Mittelpunkt stehen dabei Themen wie Kapitalallokation, Performencemessung und strategische Assetallokation.

Die Vorlesung richtet sich an Studenten mittlerer Semester mit Interesse an aktuellen Fragestellungen der Versicherungswirtschaft.

Gute Kenntnisse in der Stochastik sind unerlässlich, Kenntnisse in Schadenversicherungsmathematik und über Risikomaße sind hilfreich, werden aber in der Vorlesung bereitgestellt.

Vorkenntnisse: Stochastik II

Beginn: Dienstag, den 13. April 2010