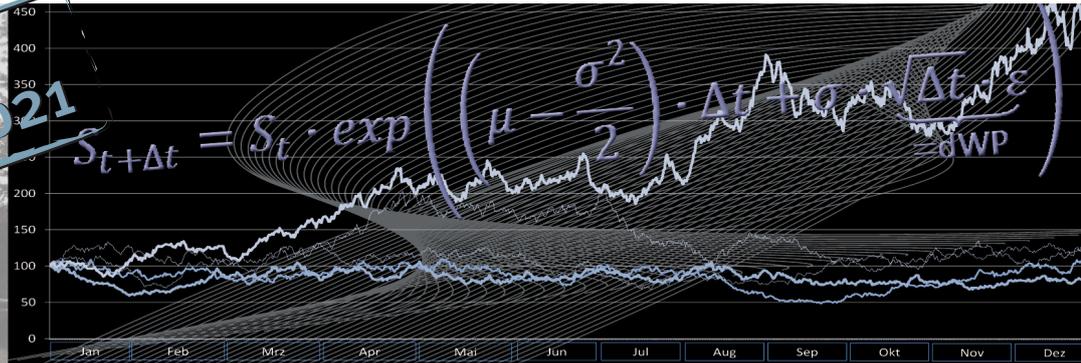


27. - 28.  
September 2021



**AKADEMIE**  
FÜR WISSENSCHAFT, WIRTSCHAFT UND TECHNIK  
an der Universität Ulm e. V.

## Stochastische Modellierung und Chance-Risiko-Profile von Altersvorsorgeprodukten 27. - 28. September 2021

Veranstaltungsort | Wissenschaftszentrum der Universität Ulm auf Schloss Reisenburg bei Günzburg

Transparenz von Altersvorsorgeprodukten ist vor dem Hintergrund nationaler und europäischer Anforderungen (z. B. AltvPIBV, PRIIP-KID) ein viel diskutiertes Thema. Die stochastische Modellierung von Altersvorsorgeprodukten spielt für die Anbieter dabei eine wichtige Rolle. Eine Methode, die Wirkungsweise von Altersvorsorgeprodukten transparent zu machen, sind so genannte Chance-Risiko-Profile und Chance-Risiko-Klassen.

### Schulungsinhalte:

- Modellierung und deterministische Hochrechnungen von Altersvorsorgeprodukten (inkl. Fallbeispiel)
- Einführung in die stochastische Modellierung von Aktien und Zinsen
- Einführung in die stochastische Modellierung von Altersvorsorgeprodukten (Chance-Risiko-Profile und Chance-Risiko-Klassen)
- Berechnung von Chance-Risiko-Profilen und Chancen-Risiko-Klassen (inkl. Fallbeispiel).

### Zielgruppe

- Dieser 1 ½ tägige Workshop richtet sich an Teilnehmer, die dieses Thema grundlegend kennenlernen und erarbeiten wollen.

- Das Seminar ist so gestaltet, dass den Teilnehmern leicht der Einstieg in das Thema gelingt.

### Äußerer Rahmen:

- Praxisorientierte Weiterbildung mit mindestens 15 und maximal 25 Teilnehmern.
- Termin: 27. - 28.09.2021, Dauer: 1 ½ Tage
- Ort: Wissenschaftszentrum der Universität Ulm auf Schloss Reisenburg bei Günzburg

### Zeitlicher Rahmen:

Montag, 27.09.2021

- Vormittag**      Anreise  
**ab 12.00**        Mittagsimbiss  
**13.00 - 18.45**    Schulung mit Pausen  
**ab 19.30**        gemeinsames Abendessen

Dienstag, 28.09.2021

- 08.30 - 12.00**    Schulung mit Pausen  
**12.00 - 13.00**    Mittagspause  
**13.00 - 16.30**    Schulung mit Pausen

Anmeldung bis zum 27.08.2021

Telefax: +49 (0)731 50-31239

Anmeldung per Post, Fax 0731-50 31239, E-Mail: [aktuarfernkurs@akademie-uni-ulm.de](mailto:aktuarfernkurs@akademie-uni-ulm.de) oder unsere Homepage zum Workshop: »Stochastische Modellierung und Chance-Risiko-Profile von Altersvorsorgeprodukten« am 27.09. - 28.09.2021 auf Schloss Reisenburg.

Herr | Frau, Name, Vorname, Titel

Telefon | Mobil

Unternehmen

E-Mail

Position | Abteilung

Straße | Postfach

PLZ | Ort

Datum, Unterschrift

### Gebühren und Konditionen:

Die Teilnahmegebühr für die 1 ½ tägige Veranstaltung beträgt 1.090,- € inkl. Tagungsverpflegung, Abendessen am 1. Schulungstag und Schulungsunterlagen. Wir melden Sie automatisch zur Übernachtung mit Frühstück im Wissenschaftszentrum zum Preis von 74,90 € bzw. 79,90 € inkl. 7% MwSt. (je nach Zimmerkategorie, Stand 2020) an. Bei Anmeldung bis zum 30.07.2021 reduziert sich die Teilnahmegebühr auf 1.040,- €. Ein Recht auf Teilnahme besteht nicht. Bei Stornierung der Anmeldung (nur schriftlich) bis zum Ablauf der Anmeldefrist am 27.08.2021 erheben wir eine Bearbeitungsgebühr von 70,- €. Bei Stornierung zu einem späteren Zeitpunkt wird die gesamte Gebühr fällig. Wir akzeptieren gerne einen Ersatzteilnehmer. Bei Absage der Veranstaltung durch die AKADEMIE wird die gezahlte Gebühr zurück erstattet. Programmänderungen aus dringendem Anlass behält sich die AKADEMIE vor. Im Übrigen gelten die Geschäftsbedingungen der AKADEMIE.

### Die Teilnehmer/innen sollen lernen

- wie die grundsätzliche Funktionsweise ausgewählter Altersvorsorgeprodukte ist,
- welche aktuellen Trends man im Bereich des Vergleichs von Altersvorsorgeprodukten beobachtet,
- wie Altersvorsorgeprodukte deterministisch und stochastisch modelliert werden,
- welchen Nutzen Chance-Risiko-Profile und Chance-Risiko-Klassen beim Vergleich von Altersvorsorgeprodukten bringen und wie man diese implementiert,
- welche Anforderungen auf nationaler und europäischer Ebene existieren und wie diese umzusetzen sind.

- Bei Bedarf bieten die Dozenten am Vormittag des ersten Tages eine einstündige Einführung / Auffrischung zu VBA an.
- Fallbeispiele: Ein besonderes Augenmerk liegt auf der praxisnahen Gestaltung des Workshops. Die Teilnehmer werden im Verlauf des Seminars selbst ein Tool zur deterministischen und stochastischen Modellierung von Fondspolizen in Excel umsetzen und dabei verschiedene Auswertungen kennen lernen sowie Chance-Risiko-Profile selbst berechnen (Gruppenarbeit). Grundkenntnisse in Excel / VBA sind hilfreich
- Die Teilnehmer werden hierzu gebeten, sofern möglich, einen Laptop mitzubringen.

Der Workshop wird von der DAV als formale Weiterbildung anerkannt.

## Schulungsort

Das Wissenschaftszentrum der Universität Ulm auf Schloss Reisenburg bei Günzburg bietet durch sein Ambiente und die ruhige Lage ein optimales Umfeld für eine zielgerichtete Schulung und den intensiven Meinungs austausch zwischen den Teilnehmern und Referenten, auch über die regulären Schulungszeiten hinweg.

Der Anreisebahnhof zum Schloss Reisenburg ist Günzburg. Die EC-Verbindungen aus Richtung Stuttgart und München halten in Günzburg.

### Fachliche Leitung:

Dr. Alexander Kling  
Institut für Finanz- und Aktuarwissenschaften  
Universität Ulm

### Weiterbildungsangebote des Veranstalters:

Die AKADEMIE AN DER UNIVERSITÄT ULM e. V. bietet eine umfangreiche Palette an berufs begleitenden **Fernkursen** in Finanz- und Aktuarwissenschaften sowie zum Prozessmanagement an. Diese bieten eine sehr gute Möglichkeit zur Einarbeitung in das spezielle Themengebiet, zur Vorbereitung auf den Master in Aktuarwissenschaften der Universität Ulm als auch für die effiziente Vorbereitung auf die Grundwissen-Prüfungen zum Aktuar DAV. Zu ausgewählten Themen veranstaltet die Akademie regelmäßig **Seminare und Workshops**.

Für **Firmen** führt die AKADEMIE die Kurse und Workshops in kompakter Form als Inhouse-Schulung, speziell auf Unternehmensanforderungen abgestimmt, durch. Einige additive Themen werden ausschließlich als **firmeninterne Workshops** angeboten (z. B. Grundlagen Stochastischer Modelle, Kommunikation für Aktuare, Fit für Solvency II, neu: Stochastische Sterblichkeitsmodellierung in der Produktentwicklung). Alle Workshops sind so konzipiert, dass sie für das Weiterbildungszertifikat der DAV als formelle Weiterbildung genutzt werden können. Die Akademie bietet allen Mitarbeitern, bis hin zum Funktionsträger im Rahmen der Anforderungen zu »fit & proper«, eine adäquate Weiterbildung. Weiter Informationen finden Sie unter:

[www.uni-ulm.de/einrichtungen/akademie-fuer-wissenschaft-wirtschaft-und-technik/kursprogramm/finanz-und-aktuarwissenschaften](http://www.uni-ulm.de/einrichtungen/akademie-fuer-wissenschaft-wirtschaft-und-technik/kursprogramm/finanz-und-aktuarwissenschaften)

## Kontakt | Weitere Informationen

### Akademie für Wissenschaft, Wirtschaft und Technik an der Universität Ulm e. V.

#### Ansprechpartner:

Frau Beate Renner  
Helmholtzstraße 22  
D-89081 Ulm

Phone: 0731 50-31248

Internet: [www.uni-ulm.de/akademie](http://www.uni-ulm.de/akademie)  
E-Mail: [aktuarfernkurs@akademie-uni-ulm.de](mailto:aktuarfernkurs@akademie-uni-ulm.de)



A K A D E M I E

FÜR WISSENSCHAFT, WIRTSCHAFT UND TECHNIK  
an der Universität Ulm e. V.

Weitere Informationen erhalten Sie aktuell unter

[www.uni-ulm.de/akademie](http://www.uni-ulm.de/akademie)

