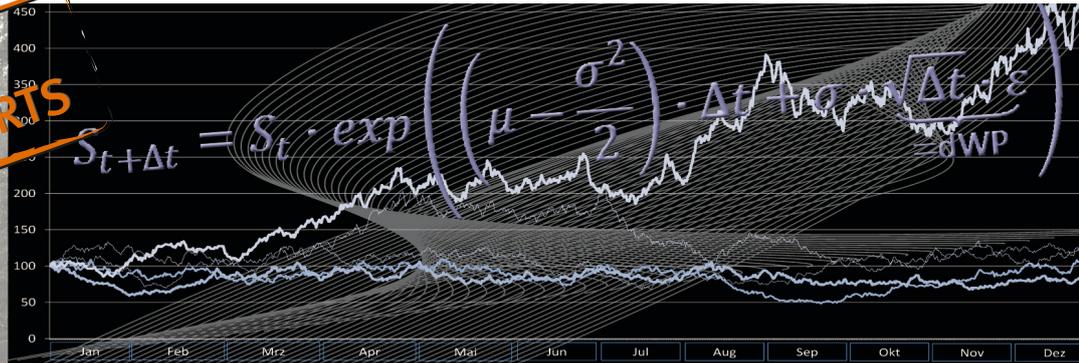


Update 2023
inkl. neuer PRIIP-RTS



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

Stochastische Modellierung und Chance-Risiko-Profile von Altersvorsorgeprodukten 29. –30. Juni 2022

Veranstaltungsort | Tagungszentrum Villa Eberhardt, Ulm

Transparenz von Altersvorsorgeprodukten ist vor dem Hintergrund nationaler und europäischer Anforderungen (z. B. AltvPIBV, PRIIP-KID) ein viel diskutiertes und sehr aktuelles 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. Spätestens mit der Einführung einer Risikoklasseneinteilung zertifizierter Produkte gemäß PIA und dem europaweit eingeführten und aktuell zur Überarbeitung anstehenden Basisinformationsblatt (PRIIP-KID) ist die stochastische Simulation von Altersvorsorgeprodukten damit ein Pflicht-Thema für jeden Anbieter von Altersvorsorgeprodukten, welches ständigen Veränderungen unterliegt. So hat die Produktinformationsstelle Altersvorsorge ihr Modell dieses Jahr beispielsweise überarbeitet und eine neue Version unter dem Stichwort PIA 2.0 erstellt.

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: Mittwoch 29.06.2022, Beginn 13:00 Uhr bis Donnerstag 30.06.2022, Ende 16:30 Uhr
- Ort: Villa Eberhardt | Heidenheimer Straße 80 | 89075 Ulm

Anmeldung bis zum 03.06.2022

Anmeldung per Post, Fax 0731-50 31239, E-Mail: aktuarfernkurs@akademie-uni-ulm.de oder unsere Homepage zum Workshop: »Stochastische Modellierung und Chance-Risiko-Profile von Altersvorsorgeprodukten« am 29.06. – 30.06.2022 im Tageszentrum Villa Eberhardt, Ulm.

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 1.120,- € inkl. Tagungsverpflegung und Schulungsunterlagen. Bei Anmeldung bis zum 06.05.2022 reduziert sich die Teilnahmegebühr auf 1.070,- €. Ein Recht auf Teilnahme besteht nicht. Bei Stornierung der Anmeldung (nur schriftlich) bis zum Ablauf der Anmeldefrist am 03.06.2022 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 eine 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.

Zeitlicher Rahmen:

Mittwoch 29.06.2022

Vormittag Anreise
ab 12.00 Mittagsimbiss
13.00 – 18.45 Schulung mit Pausen

Donnerstag, 30.06.2022

08.30 – 12.00 Schulung mit Pausen
12.00 – 13.00 Mittagspause
13.00 – 16.30 Schulung mit Pausen

Fachliche Leitung:

Dr. Alexander Kling
Institut für Finanz- und Aktuarwissenschaften

Referenten:

Dr. Alexander Kling,
Institut für Finanz- und Aktuarwissenschaften
Dr. Stefan Graf,
Munich Re

Weiterbildungsangebote des Veranstalters:

Die AKADEMIE AN DER UNIVERSITÄT ULM e. V. bietet eine umfangreiche Palette an berufsbegleitenden **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 unternehmensinterne Workshops angeboten (z. B. Grundlagen Stochastischer Modelle, Kommunikation für Aktuarien, Fit für Solvency II). 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-wissenschaftswirtschaft-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
E-Mail: 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

