

Die FaRis & DAV-Symposien

Die Forschungsstelle FaRis bündelt die aktuariellen Forschungsaktivitäten des Instituts für Versicherungswesen an der Fachhochschule Köln. FaRis versteht sich dabei als Bindeglied zwischen mathematischer Forschung und wirtschaftswissenschaftlichen Fragestellungen.

Die Deutsche Aktuarvereinigung e.V. (DAV) ist die Vertretung der Aktuare in Deutschland. Sie schafft Rahmenbedingungen für eine fachlich fundierte Berufsausbildung und vertritt die Interessen des Berufsstandes gegenüber Politik und Öffentlichkeit.

Die FaRis & DAV-Symposien haben zum Ziel, aktuell relevante Fragestellungen nicht nur Aktuaren, sondern auch Personen an den Schnittstellen zu aktuariellen Tätigkeiten näher zu bringen. In diesem Selbstverständnis sind die Symposien auch ein geeignetes Mittel zur aktuariellen Weiterbildung.

Daher wird im Rahmen des DAV-Weiterbildungsprogramms die Teilnahme an diesen Symposien mit drei Weiterbildungsstunden anerkannt.

Anmeldung und Kontakt

Die Anmeldung ist online unter:
www.fh-koeln.de/faris möglich.

Die Teilnahme ist kostenfrei.

Informationen zur Veranstaltung erteilt:

Marcel Berg

Telefon: 02 21 - 82 75 - 38 04 / marcel.berg@fh-koeln.de

Veranstaltungsort

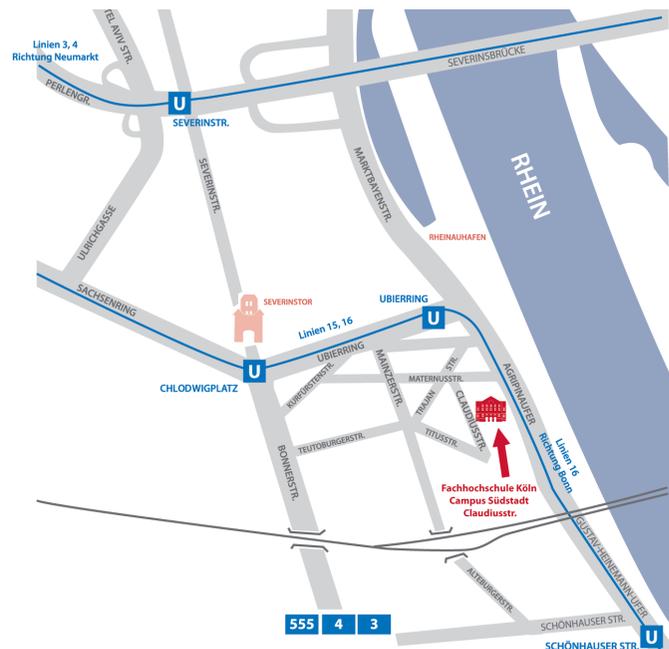
Fachhochschule Köln / Campus Südstadt
Hörsaal 69, Claudiusstraße 1
50678 Köln

Parkmöglichkeit

Tiefgarage Rheinauhafen an der Rheinuferstraße
auf Höhe des Campus Südstadt der Fachhochschule Köln

Anfahrt mit öffentlichen Verkehrsmitteln

Straßenbahnlinien 15, 16, Bus 133 – Haltestelle Ubiering



FaRis
Forschungsstelle actuarielle
Modelle & Methoden
im Risikomanagement

DAV
DEUTSCHE
AKTUARVEREINIGUNG e.V.

8. FaRis & DAV SYMPOSIUM

Kapitalanlagerisiken:
Economic Scenario Generator
und Liquiditätsmanagement

12. Juni 2015, 14.00 – 17.30 UHR

Kapitalanlagerisiken: Economic Scenario Generator und Liquiditätsmanagement

Vereinfacht formuliert könnte man sagen: Risikomanagement ist die Strategie, um auf das Unerwartete vorbereitet zu sein. Risikomanagement setzt also voraus, dass man auch das Unerwartete bedenkt, dass man also darüber nachdenkt, was alles passieren kann. Ein Economic Scenario Generator (ESG) soll abbilden, „was alles passieren kann“. Die Anforderungen der Praxis an einen ESG sind sehr hoch, denn es müssen makroökonomische Daten, Verhaltensparameter und vor allem Kapitalmarktszenarien generiert werden. Die Szenarien müssen in sich konsistent sein und sie müssen extreme Situationen abdecken, ohne dabei unrealistisch zu sein. Richard Urbach, einer der weltweit profiliertesten Entwickler von ESG-Tools, berichtet über seine Erfahrungen (The What's and Why's of an ESG).

Anknüpfend hieran soll das Liquiditätsrisiko ein zweiter Schwerpunkt des Symposiums sein. Dazu wird Ralf Knobloch zunächst das Management des Liquiditätsrisikos aus betriebswirtschaftlicher Sicht unabhängig von der Branche beleuchten. In der Betriebswirtschaftslehre hat sich für den Umgang mit Risiken eine ganzheitliche Sichtweise etabliert.

Die Unternehmen begreifen Risikomanagement als Aufgabe der Unternehmensführung, die auf einer systematischen und kontinuierlichen Identifikation, Bewertung, Steuerung und Überwachung der Risikopotentiale basiert. Der Vortrag beschäftigt sich mit den wesentlichen Grundlagen dieses betriebswirtschaftlichen Konzepts und der Frage, wie das Liquiditätsrisiko dabei behandelt wird.

Im letzten Vortrag steht wieder die Versicherungsbranche im Mittelpunkt des Interesses. Anknüpfend an eine gemeinsame Studie von FaRis und der COMPIRICUS AG wird Thomas Büttner ein ganzheitliches Konzept zum Management des Liquiditätsrisikos unter Einbeziehung der Aktiv- und Passivseite in einem Versicherungsunternehmen vorstellen. Schwerpunkte des Vortrags sind u.a. die Bedeutung der korrekten Ermittlung des Liquiditätsexposures und der ökonomische Nutzen des Liquiditätsmanagements.

Programm

14:00 Uhr

Prof. Dr. Oskar Goecke

Fachhochschule Köln, Institut für Versicherungswesen

Begrüßung und Eröffnungsvortrag

14:15 Uhr

Dr. Richard Urbach

*Managing Director, Risk & Capital Management Solutions,
Conning Germany GmbH*

The What's and Why's of an Economic Scenario Generator
anschließend: Diskussion

15:15 Uhr

Kaffeepause

15:45 Uhr

Prof. Dr. Ralf Knobloch

Fachhochschule Köln, Schmalenbach Institut für Wirtschaftswissenschaften

Management von Liquiditätsrisiken aus betriebswirtschaftlicher Sicht

16:15 Uhr

Thomas Büttner

COMPIRICUS AG

Ganzheitliches Liquiditätsmanagement in Versicherungsunternehmen

anschließend: Diskussion

17:30 Uhr

Get-together

