

Workshop: Risikoaggregation Anforderungen aus dem IDW PS 981 & IDW PS 340

Lernen Sie, wie Sie Risiken mit geeigneten Wahrscheinlichkeitsverteilungen beschreiben, mit richtigen Maßen messen, Abhängigkeiten zwischen den Risiken beschreiben, mittels Monte-Carlo-Simulation aggregieren und die Ergebnisse visualisieren können.

Wir bieten Ihnen drei verschiedene Workshop-Optionen an.

[Eintägiger Workshop: Themen

- Kurzüberblick zu den rechtlichen Voraussetzungen
- Risikoaggregation im neuen IDW PS 340
- Varianz-Kovarianz-Ansatz: Vor- und Nachteile
- Von der Szenarioanalyse zur Simulation
 - Szenarioanalyse
 - Historische Simulation
 - Monte-Carlo-Simulation als de-facto-Standard der Risikoaggregation
- Input einer Monte-Carlo-Simulation
 - Dateninput und Datenaufbereitung für die Monte-Carlo-Simulation
 - Expertenschätzungen
- Zur Parametrisierung von Verteilungen (Fitting)
- Korrelationen und Ausblick auf Copulae
- Ergebnisse einer Simulation
 - Risikomaße
 - Performancemaße und Risikokapital

Gerne erweitern bzw. variieren wir die Themenliste gemäß Ihren individuellen Anforderungen.

[Zweitägiger Workshop: Themen

- Kurzüberblick zu den rechtlichen Voraussetzungen
- Risikoaggregation im neuen IDW PS 340
- Diverse Methoden der Risikoaggregation
 - Varianz-Kovarianz-Ansatz: Vor- und Nachteile
 - Historische Simulation
 - Monte-Carlo-Simulation als de-facto-Standard der Risikoaggregation
 - Kombination von historischer Simulation und Monte-Carlo-Simulation
- Aufbau eines Simulationsmodells
 - Zweckbestimmung
 - Zeithorizont
 - Kriterien einer geeigneten Segmentierung der Risiken
 - Berücksichtigung kausaler Abhängigkeiten
- Kalibrierung des Modells
 - Schadendaten: Datenreinigung, Schadenhöheninflationierung, Anpassung der Frequenzdaten
 - Über das Fitting von Verteilungsfunktionen
 - Methoden der Erhebung von Expertenschätzungen
 - Korrelationen: lineare Korrelation oder Rangkorrelation, Fallstricke
 - Verwendung von Copulae: Typen, Kalibrierung
- Auswertung der Simulationsergebnisse
 - Risikomaße
 - Performancemaße
 - Risikokapital und Risikokapitalallokation

Gerne erweitern bzw. variieren wir die Themenliste gemäß Ihren individuellen Anforderungen.

[Dreitägiger Workshop: Themen

- Kurzüberblick zu den rechtlichen Voraussetzungen
- Risikoaggregation im neuen IDW PS 340
- Diverse Methoden der Risikoaggregation
 - Varianz-Kovarianz-Ansatz: Vor- und Nachteile
 - Weitere analytische Methoden
 - Historische Simulation
 - Monte-Carlo-Simulation als de-facto-Standard der Risikoaggregation
 - Kombination von historischer Simulation und Monte-Carlo-Simulation
- Aufbau eines Simulationsmodells
 - Zweckbestimmung
 - Zeithorizont
 - Kriterien einer geeigneten Segmentierung der Risiken
 - Berücksichtigung kausaler Abhängigkeiten
 - Sensitivitätsrisiken
- Kalibrierung und Testen des Modells
 - Schadendaten: Datenreinigung, Schadenhöheninflationierung, Anpassung der Frequenz-daten
 - Über das Fitting von Verteilungsfunktionen
 - Methoden der Erhebung von Expertenschätzungen
 - Korrelationen: lineare Korrelation oder Rangkorrelation, Fallstricke
 - Verwendung von Copulae: Typen, Kalibrierung
 - Das Testen des Simulationsmodells
- Auswertung der Simulationsergebnisse
 - Risikomaße
 - Performancemaße
 - Risikokapital und Risikokapitalallokation
- Ausblick und weitere Methoden
 - Markov Ketten
 - Machine Learning

Gerne erweitern bzw. variieren wir die Themenliste gemäß Ihren individuellen Anforderungen.