

## Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

**Dr. Andreas Kull**

Converium Ltd, <http://www.converium.com/>

### **Solvency II: Ein neues Aufsichtsmodell für die Versicherungswirtschaft in der EU**

In den vergangenen Jahren hat sich die Versicherungswirtschaft in der Europäischen Union grundlegend geändert. Die Deregulierung in den 90' er Jahren hat Versicherern mehr Freiheit und Eigenständigkeit und damit neue Chancen gebracht. Gleichzeitig sind aber auch die Herausforderungen und die Eigenverantwortung gewachsen. Nicht nur Versicherungsunternehmen, sondern auch die Aufsichtsbehörden müssen dieser neuen Situation Rechnung tragen. Auf europäischer Ebene wird deshalb zur Zeit unter der Bezeichnung "Solvency II" ein Aufsichtsmodell entwickelt, das die Solvenzbestimmungen grundlegend neu regeln soll.

Im ersten Teil des Vortrages werden der internationale Kontext und die Kerninhalte von "Solvency II" dargestellt. Stichworte hierzu sind das "Drei-Säulen-Prinzip", der risiko- bzw. marktwertbasierte Ansatz von "Solvency II", firmeninterne Risikomodelle und die Einführung neuartiger Kapitalanforderungen (Minimal- und Ziel-Solvenzkapital). Der zweite Teil des Vortrages konzentriert sich auf quantitative und aktuarielle Aspekte von "Solvency II". Es werden Anforderungen an firmeninterne Risikomodelle diskutiert und am Beispiel eines einfachen Simulationsmodells illustriert.

Dr. Andreas Kull is a senior risk consultant responsible for advising clients on the efficiency of reinsurance structures, risk capital and asset allocation based on Converium's approach to Dynamic Financial Analysis. He graduated from the University of Bern with a diploma in physics and received his PhD in physics from the Ludwig Maximilians University in Munich. Dr. Kull joined Converium in 2002. Prior to joining Converium, he gained three years of experience in both the traditional and non-traditional (re-)insurance industry. He is a member of the Deutsche Aktuarvereinigung (DAV) and the Schweizerische Aktuarvereinigung (SAV).

**Termin:** Donnerstag, **22. Jänner 2004**, 16:30 Uhr s.t.

**Ort:** **Technische Universität Wien**  
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8-10  
Freihaus, Turm C (grüner Bereich), 6. Stock,  
Seminarraum 107

**Webseite:** <http://www.fam.tuwien.ac.at/vr/>

Direktor Helmut Holzer  
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs  
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins  
der Versicherungsmathematik

Gen.-Dir. Dr. Siegfried Sellitsch  
Präsident der Österr. Gesellschaft  
für Versicherungsfachwissen

Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock  
Institut für Finanz- und Versicherungsmathematik  
Technische Universität Wien

o.Univ.-Prof. Dr. W. Schachermayer  
Institut für Finanz- und Versicherungsmathematik  
Technische Universität Wien