

AKTUARVEREINIGUNG ÖSTERREICHS

ÖSTERREICHISCHE GESELLSCHAFT
FÜR VERSICHERUNGSFACHWISSEN

VIENNA INSTITUTE OF FINANCE

TECHNISCHE UNIVERSITÄT WIEN
FORSCHUNGSGRUPPE FÜR FINANZ-
UND VERSICHERUNGSMATHEMATIK

UNIVERSITÄT WIEN
FAKULTÄT FÜR MATHEMATIK

Einladung zur Vortragsreihe aus Finanz- und Versicherungsmathematik

Prof. Dr. Angelika May

Carl von Ossietzky Universität Oldenburg

<http://www.mathematik.uni-oldenburg.de/personen/may/may.html>

CPPI Models for life insurance products with guarantees

We discuss and compare different approaches for unit linked life insurance products with guarantee, with focus on hybrid products on the one hand, and CPPI products on the other hand. We will show some simulation results for a simple model and then continue with a theoretical view on models with jumps.

Angelika May holds a chair on mathematics in economics at the University of Oldenburg. Her research interest covers asset management for life insurance companies and stochastic models for life and health insurances. She has worked on different projects with the financial services industry on multivariate approaches for Risk Management using the copula method.

Termin: Dienstag, 27. Januar 2009, 16:30 Uhr s.t.

Ort: **Technische Universität Wien**
1040 Wien, Wiedner Hauptstraße 8-10
Freihaus, Turm A (grüner Bereich), 7. Stock,
Zeichensaal 3

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

Mag. Christoph Krischanitz
Präsident der Aktuarvereinigung Österreichs
Präsident des Österreichischen Förderungsvereins
der Versicherungsmathematik

Dkfm. Dr. Siegfried Sellitsch
Präsident der Österreichischen Gesellschaft
für Versicherungsfachwissen

Univ.-Prof. Dr. Uwe Schmock
Finanz- und Versicherungsmathematik (FAM)
Technische Universität Wien

o.Univ.-Prof. Walter Schachermayer
Institut für Mathematik, Universität Wien

Univ.-Prof. Dr. Damir Filipović
Vienna Institute of Finance