

Nürnberg, 03.04.2017

Einladung
zu einem versicherungsmathematischen Gastvortrag an der FAU
—
Eine gemeinsame Veranstaltung der Fachbereiche Mathematik und
Wirtschaftswissenschaften an der FAU Erlangen-Nürnberg

Sehr geehrte Damen und Herren,

Forum V, das nordbayerische Institut für Versicherungswissenschaft und -wirtschaft an der Friedrich-Alexander-Universität (FAU) Erlangen-Nürnberg e.V., freut sich sehr, Sie im Namen der beiden Fachbereiche Mathematik und Wirtschaftswissenschaften an der Friedrich-Alexander-Universität Erlangen-Nürnberg ganz herzlich zu einem versicherungsmathematischen Gastvortrag von **Herrn Prof. Elias S. W. Shiu, PhD** (Department of Statistics and Actuarial Science, University of Iowa, USA) einladen zu dürfen, der zu einem gemeinsamen Forschungsprojekt mit Prof. Dr. Hans U. Gerber von der University of Lausanne und Prof. Hailiang Yang von der University of Hong Kong referieren wird. Thema des Vortrags wird sein:

“Valuing equity-linked death benefits in jump-diffusion models”

Abstract: “Nowadays, many products sold by U.S. life insurance companies are investment funds wrapped around with options and guarantees. Many of these guarantees should be priced, hedged, and reserved using modern option-pricing theory and sophisticated mathematical tools such as martingales, Brownian motion, stochastic differential equations, and so on. By applying a version of the Wiener-Hopf factorization, this talk will show that, if the guarantees are exercisable only at the moment of death of the policyholder, their valuation turns out to be an elementary calculus exercise.”

Der Gastvortrag findet am **Dienstag, den 30. Mai 2017, von 16.45 Uhr bis 18.15 Uhr im Raum LG 4.154** an der WiSo der FAU Erlangen-Nürnberg statt (Lange Gasse 20, 90403 Nürnberg). Die Teilnahme an der Veranstaltung ist kostenlos.

Geschäftsführung: Philipp Lechner, M. Sc.

Postanschrift:
Forum V
Lange Gasse 20
90403 Nürnberg

Telefon:
0911 / 23739-893
Telefax:
0911 / 23739-333

Internet:
www.forum-v.de
E-Mail:
info@forum-v.de

Steuernummer: 241/108/33543

Bankverbindung:
Sparkasse Nürnberg
IBAN: DE94760501010010683183
BIC: SSKNDE77XXX



Nordbayerisches Institut für Versicherungswissenschaft
und -wirtschaft an der Friedrich-Alexander-Universität
Erlangen-Nürnberg e.V.

Die Veranstaltung ist bei der **Deutschen Aktuarvereinigung e.V. (DAV) akkreditiert** und kann als formale Weiterbildung im Umfang von zwei Stunden angerechnet werden. Eine entsprechende Teilnahme werden wir auf Wunsch direkt elektronisch an die DAV übermitteln.

Bitte melden Sie sich zur Veranstaltung über das beiliegende Anmeldeformular oder per Webanmeldung über www.forum-v.de an.

Wir freuen uns auf Ihre Teilnahme und stehen bei Rückfragen immer gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

Prof. Dr. Nadine Gatzert
Vorstandsvorsitzende **Forum V** e.V.
Lehrstuhl für Versicherungs-
wirtschaft und Risikomanagement
(FAU Erlangen-Nürnberg)

Prof. Dr. Wolfgang Stummer
Department Mathematik
(FAU Erlangen-Nürnberg)

Prof. Dr. Ingo Klein
Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie
(FAU Erlangen-Nürnberg)

Geschäftsführung: Philipp Lechner, M. Sc.
Postanschrift: **Forum V**
Lange Gasse 20
90403 Nürnberg
Telefon: 0911 / 23739-893
Telefax: 0911 / 23739-333

Internet: www.forum-v.de
E-Mail: info@forum-v.de

Steuernummer: 241/108/33543
Bankverbindung:
Sparkasse Nürnberg
IBAN: DE94760501010010683183
BIC: SSKNDE77XXX

Anmeldung: Versicherungsmathematischer Gastvortrag an der FAU

Zur Vereinfachung der Anmeldung melden Sie sich bevorzugt über unser Webformular an:

Web-Anmeldung: [Anmeldeformular](#)

Alternativ können Sie die Anmeldung nach wie vor auch per Fax an uns senden: 0911 / 23739-333

Versicherungsmathematischer Gastvortrag an der FAU

Referent: Prof. Elias S. W. Shiu, PhD (Department of Statistics and Actuarial Science, University of Iowa, USA)

Thema: Valuing equity-linked death benefits in jump-diffusion models

Termine: Dienstag, 30.05.2017

Zeit: 16:45 Uhr bis 18.15 Uhr

Ort: Fachbereich Wirtschaftswissenschaften der Friedrich-Alexander-Universität Erlangen-Nürnberg, Lange Gasse 20, 90403 Nürnberg

Raum: LG 4.145

Ansprechpartner: Philipp Lechner, Geschäftsführer **Forum V**

Name: _____ Vorname: _____

Unternehmen: _____ Position: _____

Straße: _____ PLZ, Ort: _____

Telefon: _____ Fax: _____

E-Mail: _____ DAV-Mitgliedsnummer: _____

- Ja, ich bin damit einverstanden auch zukünftig Informationen zu aktuellen Themen und Veranstaltungen von **Forum V** zu erhalten.
- Ja, ich wünsche eine Anrechnung der Veranstaltung als formale Weiterbildung im Umfang von je zwei Stunden pro Termin bei der DAV.

Datum: _____

Unterschrift: _____

Geschäftsführung: Philipp Lechner, M. Sc.

Postanschrift:
Forum V
Lange Gasse 20
90403 Nürnberg

Telefon:
0911 / 23739-893
Telefax:
0911 / 23739-333

Internet:
www.forum-v.de
E-Mail:
info@forum-v.de

Steuernummer: 241/108/33543

Bankverbindung:
Sparkasse Nürnberg
IBAN: DE947605010010683183
BIC: SSKNDE77XXX