

Pozvánka na konferenciu

Katedra matematiky a aktuárstva

Fakulta hospodárskej informatiky Ekonomickej univerzity v Bratislave

Aktuárska veda v teórii a v praxi

KMA FHI EU v Bratislave Vás pozýva na 10. ročník medzinárodnej vedeckej konferencie, ktorú organizuje v spolupráci so Slovenskou spoločnosťou aktuárov. Konferencia sa zameriava najmä na vybranú problematiku životného, neživotného, penzijného a nemocenského poistenia a finančných analýz v aktuárstve v kontexte zmien *Solventnosti II* a *ORSA*. Cieľom konferencie je vytvoriť priestor pre prezentáciu dosiahnutých výsledkov v uvedených vedných oblastiach a súčasne poskytnúť priestor pre stretnutie a vzájomnú diskusiu pracovníkov vysokých škôl a výmenu pedagogických skúseností z výučby aktuárskych predmetov. Výstupom z konferencie bude zborník recenzovaných príspevkov s ISBN.

Vedecká konferencia sa uskutoční dňa: **12. – 13. novembra 2015**

Miesto konania konferencie: **EU v Bratislave – Spoločenská miestnosť budova V1
Dolnozemska cesta 1, Bratislava, Slovensko**

Vedecký výbor konferencie:

prof. Dr. Ing. Dana Dluhošová	Vysoká škola báňská – TU Ostrava
prof. RNDr. Viera Pacáková, PhD.	Univerzita Pardubice
prof. RNDr. Katarína Sakálová, CSc.	Ekonomická univerzita v Bratislave
prof. RNDr. Vincent Šoltés, CSc.	Technická univerzita v Košiciach
doc. RNDr. Jozef Fecenko, CSc.	Ekonomická univerzita v Bratislave
doc. RNDr. Galina Horáková, CSc.	Ekonomická univerzita v Bratislave
doc. Mgr. Erik Šoltés, PhD.	Ekonomická univerzita v Bratislave
Ing. Mária Kamenárová	Slovenská spoločnosť aktuárov

Programový a organizačný výbor konferencie:

doc. RNDr. Mária Bilíková, PhD.
Mgr. Jozef Hančár
Mgr. Andrea Kaderová, PhD.
Ing. Jana Mihalechová
Ing. Michal Páleš, PhD.
Mgr. Tatiana Šoltéssová, PhD.

Rokovací jazyk konferencie: anglický, český, slovenský

Kontaktná emailová adresa: asc.bratislava@gmail.com

Konferenčný poplatok (vložené): 30.00 EUR

Poplatok zahŕňa občerstvenie, technické zabezpečenie, spracovanie príspevkov a prípravu a vydanie zborníka príspevkov.

Informácie k úhrade vloženého budú zaslané prihláseným účastníkom emailom.

Daňový doklad bude vydaný na konferencii príp. zaslaný účastníkovi poštou spolu so zborníkom.

Príspevok bude prijatý a publikovaný v zborníku len po úspešnom recenznom konaní.

Ubytovanie:

V prípade záujmu možno nájsť ubytovanie v Bratislave na www.booking.com.

Dôležité termíny:

- **účasť na konferencii s príspevkom** treba potvrdiť vyplnením elektronickej prihlášky **do 31. 8. 2015** (spolu s prihláškou treba zaslať aj **abstrakt príspevku**),
- **konečnú verziu príspevku** v ľubovoľnom rokovačom jazyku konferencie, podľa predpísanej šablóny, je potrebné zaslať **do 25. 9. 2015**,
- **účasť na konferencii bez príspevku** treba potvrdiť vyplnením elektronickej prihlášky **do 1. 10. 2015**,
- za obsahovú a formálnu úroveň zaslaných príspevkov zodpovedajú ich autori,
- všetky príspevky budú recenzované, v prípade nevyhovujúceho formátu alebo obsahu budú vrátené autorom na prepracovanie,
- program konferencie bude zverejnený najneskôr mesiac pred plánovaným termínom konferencie.

Všetky informácie budú postupne zverejnené na:

<http://fhi.sk/sk/km/konferencie-seminare/aktuarska-veda-2015.html>

Rámcový program konferencie:

I. deň • 12. november 2015 (štvrtok)

12.30 – 13.00	Prezencia účastníkov
13.00 – 14.45	Vyžiadané prednášky
14.45 – 15.15	<i>Coffee break</i>
15.15 – 17.00	Vyžiadané prednášky

II. deň • 13. november 2015 (piatok)

9.00 – 12.00	Prezentácia príspevkov prihlásených účastníkov konferencie
---------------------	--

Prednáška zahraničného host'a konferencie

Angus Macdonald: An Actuarial View of Genetics, Past Present and Future

Heriot-Watt University Edinburgh, Scotland, UK

Genetic testing in search of DNA variants associated with future disease has been a headache for insurers for the last twenty years. If they use genetic information, they stand accused of unfair discrimination. If they don't, they face possible adverse selection. Actuarial modelling can show the impact in either case, in terms of additional costs to individuals and to insurers. This talk reviews the actuarial aspects of genetics from the past - tests for rare mutations of large effect in single genes - to the present - tests for common variations of small effect in multiple genes - and offers some thoughts on the future.

Vyžiadané prednášky:

Mária Kamenárová: ORSA - Vlastné posúdenie rizík poisťovne, praktické príklady

Vlastné posúdenie rizík poisťovne tvorí základný pilier riadenia rizík s cieľom identifikovať, merať a následne riadiť riziká z pohľadu manažmentu poisťovne. Aktuárske modely tvoria základný nástroj v procese kvantifikácie dopadov na kapitálovú primeranosť poisťovne.

Ondrej Klábik: Validácia aktuárskych modelov

Prednáška uvedie problematiku validácie aktuárskych modelov používaných v praxi, ktoré sú často zastarané, málo alebo zle udržiavané, prípadne dlhodobé a nevedomky chybné. Problém je relevantný najmä vďaka zvyšujúcim sa požiadavkám na kvalitu modelov (nielen) v dôsledku Solventnosti II.

Galina Horáková: Praktické aplikácie Teórie rizika v poistení

Cieľom príspevku je prezentovať stručný súhrn stochastických metód a postupov založených na poznatkoch z Teórie rizika v poistení, aplikovateľných v praxi a korešpondujúcich s náplňou Syllabu aktuárskeho vzdelávania Slovenskej spoločnosti aktúarov. Predstavujú sa rôzne modely počtu aj výšky škôd s dôrazom na ich využitie pri odhade rezerv na poistné plnenia a odhade ekonomického kapitálu kalkulovaného podľa hodnoty VaR aj CVaR. Aplikácie ukážky sa budú týkať aj zovšeobecnenia postupov v čase a ich úlohou bude poukázať na význam stochastického prístupu pri riešení aktuárskych problémov.

Vladimír Mucha, Michal Pálež: Vizualizácia a prezentácia údajov z oblasti aktuárskej demografie využitím dynamických prvkov Microsoft Excel 2013

Príspevok sa zaoberá využitím a prezentáciou funkcionality dynamických prvkov (pivot tables, slicers, timeliner, formcontrols, dynamicfunctions, maps in PowerView) dostupných v prostredí Microsoft Excel 2013 v rámci interaktívnej analýzy údajov z oblasti aktuárskej demografie. Podporným nástrojom pre predikciu demografických ukazovateľov je analýza časových radov, pričom táto prognóza ex-ante bude využitá pre ďalšiu vizualizáciu údajov. Cieľom príspevku je tiež spracovanie „surových“ údajov v takom prezentačnom formáte, ktorý vďaka dynamickým prvkom zabezpečí vysokú úroveň jeho vypovedacej schopnosti pre potreby používateľa.

Ďakujeme Vám za záujem o konferenciu

a

tešíme sa na spoločné stretnutie.