

Forslag til opprettelse av EVU-emne i forsikring/risiko/aktuarfag

MIEVUZZZZ Risikostyring i aktuarfag

Kort om emnet

Krav og finansielle investeringer eksponerer et forsikringsselskap for risiko som må forvaltes for å oppnå best mulig inntjening til en håndterbar risiko. Investeringer i ulike aktiver eksponerer mot rente og finansrisiko, men også mot pandemi, klima og vær og for eksempel karbonrisiko. Gjennom de ulike forsikringskravene som kan komme, er også selskaper eksponert mot pandemi og klima og andre usikre faktorer. I dette kurset ser vi på hvordan man skal forvalte sine aktiva og krav under usikkerhet, der man styrer etter risikomål gitt av regulerende myndigheter og krav om ESG-forvaltning. Ulike strategier og metoder presenteres og drøftes i praktiske sammenhenger. Maskinlæringsteknikker vil anvendes. Kursets innhold vil variere og velges utifra relevans og aktualitet.

Hva lærer du

I kurset får du en innføring i de viktigste klassene av risikomål, inkludert koherente og konsistente risikomål. De ulike målene blir analysert i forskjellige aktuelle cases, for eksempel porteføljer bestående av ulike aktivaklasser og krav, og ikke-lineære derivater som oppstår i gjenforsikring. Målene må ses i sammenheng med stokastiske modeller som endret seg dynamisk over tid og faktorer, der samvariasjon og ekstreme hendelser spiller en viktig rolle. Kurset legger vekt på å vise hvordan man kan sette opp et rammeverk for å gjøre seg nytte av målene i praktiske sammenhenger, med bruk av blant annet nevralt nettverk og andre maskinlæringsteknikker.

Opptakskrav

For å ta emnet kreves det generell studiekompetanse.

Det legges i tillegg til grunn at søkere innehar utdanning tilsvarende en master i forsikring eller realfag, eventuelt økonomi og finans med et godt innslag av matematikk og statistikk.

Noen emner vil allikevel forutsette eller bygge på bestemte forkunnskaper for at du skal få utbytte av undervisningen. Selv om slike forkunnskaper ikke er et krav for opptak, vil vi fraråde å søke på emner hvor du mangler anbefalte forkunnskaper. For de emnene hvor dette er aktuelt er det angitt i emnebeskrivelsen.

Undervisning

Kurset vil gå over to dager, med 5 timer undervisning hver dag. Totalt 10 timer.

Undervisningen vil være på norsk eller engelsk, avhengig av kursleder.

For å få kursbevis kreves det at man har deltatt på all undervisning. Det gis ikke studiepoeng på kurset.

Det er ingen eksamen eller obligatoriske innleveringsoppgaver.

Kurset går ikke regelmessig, men når behov og ressurser tilsier.

Ressursbruk

Kurset krever frikjøp av en person for å forberede og gjennomføre kurset. Dette må skje etter avtale med instituttet, men i opprettelsen av disse EVU-kursene har man blitt enige om ett semesters frikjøp for en person. Seksjon 3 Risiko og Stokastikk er ansvarlige for EVU-kurset. Gjennomføringen av EVU-kurset skal ikke påvirke den ordinære undervisningen, annet enn at instituttet må betale for frikjøp for å dekke vikar. Kostnad for deltakelse må prises for å ta høyde for dette. Seksjonen vil finne personer som kan ta over ordinær undervisning når dette er aktuelt.