

11 Index

Aktuarwissenschaft	16	expected shortfall	159
Amortisationsbeträge	53	Formel von Black	252
Amortized cost	36	Formel von Itô	203
Anschaffungswert	20	Formel von Sheppard	239
asset allocation.....	163	Forward-Rate	241
Barwert.....	37	Future-Rate	243
Basissolvenzanforderungen	142	Gamma	222
Beta-Faktor.....	183	Gammafunktion	102
Boltzmann-Konstante.....	200	Gamma-Verteilung	99
Branchenrealität.....	133	geometrische Brownsche Bewegung ..	206
Brownsche Bewegung.....	196	going concern	28
Buchwerte	18	Griechen	218
BVG-Sparprozess	88	HGB	30
Call-Option	189	Hilbertraum	141
Capital Asset Pricing Modell.....	183	Ho-Lee-Modell.....	231
CAPM.....	183	Hull-White-Modell.....	231
Cashflow	37	Internationaler	
Cholesky-Zerlegung	142	Rechnungslegungsstandard	30
clean price	123	Kommutationszahlen	43
Conditional Tail Expectation.....	153	Kontraktion	248
Couponzahlung	123	Konvexität	49
Cox-Ingersoll-Ross-Modell	231	Korrelation	137
Credibilitätstheorie	167	Korrelationsmatrix	138
CTE.....	153	Kosinus	137
de Moivre	92	Kosinussatz.....	138
Delta	222	Kovarianzmatrix	164
Derivat.....	189	Lebesgues-Integral	191
dirty price	123	Leibrenten-Cashflows.....	91
Dispersion.....	50	logarithmische Normalverteilung	206
Diversifikationseffekt	144	Markowitz	171
Duration	45	Marktrealität	133
Duration-Mismatch	29	mean reversion	232
effizientes Portfolio	172	Median	206
Einstein.....	200	NAIC.....	153
EIOPA.....	151	No arbitrage	232
Elementarereignis	133	Ornstein-Uhlenbeck-Modell.....	231
Embedded value.....	26	Payer-Swaption	255
Ereignisalgebra	133	Portfoliotheorie.....	163
Erlebensfallversicherung	43	Prämien- und Rentenübertrag	120
Euler-Mascheroni-Konstante	102	Prämienübertrag	122

prinzipienbasiert	19	SST	156
Put-Option.....	189	SterbeGesetz von Gompertz.....	94
Receiver-Swaption	255	SterbeGesetz von Makeham.....	95
regelbasiert	19	stochastische Analysis	191
Rendleman-Barter-Modell	231	stochastische Zinsmodelle	229
Rentenübertrag	120	Swaptions	254
Reserveauffüllung	74	Thermodynamik	199
Rho	222	Theta	222
Risikobaum.....	147	tier 1	28
Risikobegriff	132	Todesfallversicherungen	43
risikobereinigte Kursentwicklung.....	192	Underlying.....	189
Risikokapital	129	Unternehmensrealität.....	133
SCR	148	value at risk	153
Sharpe Ratio	185	Vasicek-Modell	231
Skalarprodukt.....	141	Volatilität.....	193
Solvency II	129	Wahrscheinlichkeitsmaß	133
Solvenzkapital	131	Wärmeleitgleichung.....	198
Solvenzvorschriften in den USA	152	Zerobond.....	47
Sparprozess	80	Zinsswaps	254
Spot-Preis	241	Zufallsvariable	133
Spot-Rate.....	241		