

# Plan konferencji

## II Konferencja Naukowa Koła Finansów i Ubezpieczeń MIMUW „Opcje, fundusze, rezerwy”

### 25.04 (piątek)

- 9:00 Rozpoczęcie rejestracji
- 9:30 Otwarcie konferencji
- 10:00 - 11:00 Tomasz Tkaliński, MIM UW, „Przekleństwo wymiarów”
- 11:00 - 13:30 EY - „Wycena obligacji zamiennych na akcje – metodyka oraz modele wyceny”
- 13:30 - 14:30 *Przerwa na poczęstunek*
- 14:30 - 16:00 Generali - "Trójkąty szkodowe - przegląd różnych rodzajów trójkątów i podstawowe metody wyliczania poszczególnych rezerw IBNR"
- 16:00 - 17:00 Andrzej Palczewski, MIM UW, "Zmienność implikowana w wycenie skomplikowanych instrumentów finansowych"
- 17:00 - 17:30 *Przerwa kawowa*
- 17:30 - 18:30 Aviva, „Praktyczne wdrażanie Solvency II w zakładach ubezpieczeniowych – czy dyrektywa spowoduje rzeczywisty wzrost rezerw kapitałowych?”
- 18:30 - 20:00 Spotkanie integracyjne w “Mam Ochotę”

### 26.04 (sobota)

- 9:00 Otwarcie drugiego dnia konferencji,
- 9:15 - 10:30 Damian Skrzypiec „Ułamkowy ruch Browna i jego zastosowania”
- 10:30 - 12:00 Wojciech Otto, MIMUW, „Modelowanie ewolucji tablic trwania życia – model Lee-Cartera i jego udoskonalenia”
- 12:00 - 13:00 Fundacja Quantitative Finance, „High Frequency Trading”
- 13:00 Poczęstunek i zakończenie konferencji