

Prof. Dr. Nadine Gatzert

Geboren am 1. Dezember 1979 in Stuttgart

Staatsbürgerschaft: Deutschland



Wissenschaftliche Ausbildung und Funktionen:

- Professorin (Ordinariat) für Versicherungswirtschaft und Risikomanagement an der Friedrich-Alexander-Universität Erlangen-Nürnberg (seit 8/2009)
- Studium der Wirtschaftsmathematik an der Universität Ulm sowie an der University of Southern California, Los Angeles (Abschlüsse: Dipl.-Math. oec. und M.Sc. in Mathematical Finance)
- ab 2005 Projektleiterin und wissenschaftliche Assistentin am Institut für Versicherungswirtschaft der Universität St. Gallen (I.VW-HSG)
- 2007 Promotion an der Universität St. Gallen (Titel: "Implicit Options in Life Insurance: Valuation and Risk Assessment")
- Lehrauftrag und 2009 Habilitation an der Universität St. Gallen ("Risk Management in the Financial Services Industry: Essays on Financial Stability, Implicit Options in Financial Products, and Profit and Risk Analysis in Insurance Companies")
- 2008 Berufsexamen zur Aktuarin DAV abgeschlossen

Weitere Funktionen (Auswahl):

- Mitglied des Aufsichtsrats der ERGO Versicherungsgruppe AG (seit 5/2010)
- Mitglied des Aufsichtsrats und des Prüfungsausschusses der Württembergische Versicherung AG (seit 5/2013)
- Forschungsdekanin und Vorsitzende des Promotionsausschusses des Fachbereichs Wirtschaftswissenschaften der Universität Erlangen-Nürnberg (seit 10/2012)
- Mitglied des Leitungsgremiums der Graduiertenschule der Universität Erlangen-Nürnberg (seit 10/2012)
- Mitglied des Vorstands (seit 10/2009) und Vorsitzende des Vorstands (seit 10/2010) von Forum V, dem nordbayerischen Institut für Versicherungswissenschaft und -wirtschaft an der FAU
- Mitglied des Vorstands des Deutschen Vereins für Versicherungswissenschaft (seit 3/2013)
- Mitherausgeberin (Associate Editor) von mehreren renommierten internationalen Fachzeitschriften
- Gutachterin für zahlreiche nationale und internationale Fachzeitschriften

Preise und Forschungsauszeichnungen (Auswahl):

- 2014 Highly Commended Paper Award for 2013 (Journal of Risk Finance, Literati Network Awards for Excellence) for the paper "On the Relevance of Premium Payment Schemes for the Performance of Mutual Funds with Investment Guarantees"
- 2013 Shin Research Excellence Award of the International Insurance Society (IIS) and The Geneva Association for the paper "Fair Valuation and Risk Assessment of Dynamic Hybrid Products in Life Insurance: A Portfolio Consideration" (mit A. Bohnert)

- 2013 Outstanding Paper Award (Journal of Risk Finance, Literati Network Awards for Excellence) for the paper "The Merits of Pooling Claims Revisited" (mit H. Schmeiser)
- 2012 Early Career Scholarly Achievement Award of the American Risk and Insurance Association (ARIA)
- 2011 Risk Management & Insurance Review Best Perspective Article Award 2010 of the American Risk and Insurance Association (ARIA)
- 2007 Ernst Meyer Price of the International Association for the Study of Insurance Economics (The Geneva Association) for the doctoral thesis

Forschungsschwerpunkte:

- Finanzgarantien in Lebensversicherungsverträgen
- Enterprise Risk Management
- Versicherungsmathematik
- Alternativer Risiko Transfer (ART)
- Behavioral Insurance
- Solvency II und Regulierung
- Asset Management unter Solvency II
- Management und Versicherbarkeit von operationellen Risiken und Reputationsrisiken

Ausgewählte Publikationen und Arbeitspapiere:

- On the Management of Life Insurance Company Risk by Strategic Choice of Product Mix, Investment Strategy and Surplus Appropriation Schemes (2013), Working Paper Universität Erlangen-Nürnberg (with A. Bohnert, P. L. Jørgensen)
- New Life Insurance Financial Products (2013), chapter in Georges Dionne (Ed.), Handbook of Insurance, second edition, Springer, New York; 2013, pp. 1061-1095 (with H. Schmeiser)
- Determinants and Value of Enterprise Risk Management: Empirical Evidence from the Literature (2013) (mit M. Martin), forthcoming in: *Risk Management and Insurance Review*
- Insurers' Investment in Infrastructure: Overview and Treatment under Solvency II (2013) (mit T. Kosub), forthcoming in: *The Geneva Papers on Risk and Insurance - Issues and Practice*
- On the Risk Situation of Financial Conglomerates: Does Diversification Matter? (2008), erscheint in: *Financial Markets and Portfolio Management* (mit H. Schmeiser)
- How Does Price Presentation Influence Consumer Choice? The Case of Life Insurance Products (2010) (mit C. Huber, H. Schmeiser), forthcoming in: *Journal of Risk and Insurance*
- Fair Valuation and Risk Assessment of Dynamic Hybrid Products in Life Insurance: A Portfolio Consideration (2013) (mit A. Bohnert), in *The Geneva Papers on Risk and Insurance - Issues and Practice*
- Quantifying Credit and Market Risk Under Solvency II: Standard Approach Versus Internal Model (2012), in: *Insurance: Mathematics and Economics* Vol. 51 (2012), No. 3, pp. 649-666 (mit M. Martin)
- The Impact of Natural Hedging on a Life Insurer's Risk Situation (2010), in: *Journal of Risk Finance* Vol. 13 (2012), No. 5, pp. 396-423 (mit H. Wesker)
- Estimating the Basis Risk of Index-Linked Hedging Strategies using Multivariate Extreme Value Theory (2012) (with R. Kellner), in *Journal of Banking & Finance* Vol. 37 (2013), No. 11, pp. 4353-4367
- Optimal Risk Classification with an Application to Substandard Annuities (2009), in: *North American Actuarial Journal* Vol. 16 (2012), No. 4, pp. 462-486 (mit G. Hoermann, H. Schmeiser)