Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

Autor(en): **Klüppelberg, Claudia**

Objekttyp: **Article**

Zeitschrift: **Mitteilungen / Schweizerische Vereinigung der Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries**

Band (Jahr): **- (1990)**

Heft 2

PDF erstellt am: **26.05.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-967245

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Inhalten der Zeitschriften. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern.
Die auf der Plattform e-periodica veröffentlichten Dokumente stehen für nicht-kommerzielle Zwecke in Lehre und Forschung sowie für die private Nutzung frei zur Verfügung. Einzelne Dateien oder Ausdrucke aus diesem Angebot können zusammen mit diesen Nutzungsbedingungen und den korrekten Herkunftsbezeichnungen weitergegeben werden.
Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. Die systematische Speicherung von Teilen des elektronischen Angebots auf anderen Servern bedarf ebenfalls des schriftlichen Einverständnisses der Rechteinhaber.

Haftungsausschluss

Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr für Vollständigkeit oder Richtigkeit. Es wird keine Haftung übernommen für Schäden durch die Verwendung von Informationen aus diesem Online-Angebot oder durch das Fehlen von Informationen. Dies gilt auch für Inhalte Dritter, die über dieses Angebot zugänglich sind.

Ein Dienst der *ETH-Bibliothek*
ETH Zürich, Rämistrasse 101, 8092 Zürich, Schweiz, www.library.ethz.ch

http://www.e-periodica.ch

Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

An der Tagung, die vom 16. bis 22. September 1990 unter Leitung der Professoren H. Bühlmann (Zürich), P. Embrechts (Zürich), H. U. Gerber (Lausanne) und J. L. Teugels (Leuven) stattfand, nahmen rund 50 Wissenschaftler und Praktiker teil. In 36 Vorträgen wurden die neuesten Forschungsergebnisse aus der Versicherungsmathematik vorgestellt.

Die wichtigsten Themenschwerpunkte waren:
a) Verallgemeinerte Modelle von Risikoprozessen
b) Statistische Probleme in Verbindung mit dem Risikoprozess
c) Vergleich von Modellen für Kapitalmärkte und Versicherungsmärkte
d) Prämienberechnungsprinzipien
e) Stochastische Modelle in der Lebensversicherungsmathematik.

Vorträge zu Punkt a) behandelten Möglichkeiten zur Modellierung des Risikoprozesses unter Berücksichtigung von Kapitalbeschaffungsmöglichkeiten, der Verzinsung der freien Reserven und Inflation. Unter Punk b) wurden sowohl statistische als auch numerische Schätzverfahren für die Schadensverteilung und den Lundbergkoeffizienten vorgestellt. Zu Thema c) wurden Anwendungen des Black-Scholes-Modells diskutiert und seine Approximation durch diskrete Modelle, wie z. B. das Cox-Ross-Rubinstein-Modell, untersucht. Hauptpunkte unter d) bildeten die Prämienanpassung an die Schadensentwicklung und eine robuste Parameterschätzung in der Credibility-Theorie. Unter e) wurden z. B. stochastische Modelle für Zinsstrukturen innerhalb der Lebensversicherungsmathematik diskutiert.
Am Rande der Tagung gab es zahlreiche informelle Diskussionen, die auf einen lebhaften Gedankenaustausch auch ausserhalb des offiziellen Tagungsprogramms hinweisen.

Claudia Klüppelberg, Zürich