Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

Autor(en): **Schmidli, Hanspeter**

Objekttyp: **Article**

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

Band (Jahr): **- (1994)**

Heft 2

PDF erstellt am: **26.05.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-967201

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 18. bis 24. September 1994 unter der Leitung der Professoren H. Bühlmann (Zürich), P. Embrechts (Zürich), H. U. Gerber (Lausanne) und J. L. Teugels (Leuven) stattfand, nahmen rund 50 Wissenschaftler aus 19 Ländern teil. In 21 Vorträgen und vielen Diskussionen in kleineren Gruppen wurden die neuesten Forschungsergebnisse und Methoden vorgestellt.
Die Themenschwerpunkte waren:

a) Loss reserves
b) Risk processes and ruin
c) Mathematical finance
d) Aggregate claims and numerical methods
e) Statistics in actuarial science.

Vorträge zu Punkt a) behandelten Optimierungsprobleme für Rückstellungen und Investitionen. Unter Punkt b) wurden Verallgemeinerungen des Cramér–Lundberg-Prozesses sowie obere Grenzen für die Ruinwahrscheinlichkeiten vorgestellt. Unter Thema c) wurden verallgemeinerte Modelle der Finanzmathematik, Preisberechnungen für Optionen und Strategien zur Abdeckung von Risiken diskutiert. Die Vorträge zum Thema d) beschäftigten sich mit der exakten Berechnung und Approximation der Wahrscheinlichkeit von Ruin in endlicher und unendlicher Zeit, oder der Berechnung von optimalen Grössen, wie z. B. optimale Rückversicherung. Zu Punkt e) wurden verschiedene Methoden zur parametrischen und nichtparametrischen Schätzung von Funktionalen in der Risikotheorie präsentiert.
Die wunderbare Umgebung in Oberwolfach und die hervorragende Organisation führten zu einem regen Austausch von Ideen und zu vielen Diskussionen über zukünftige Forschungsprojekte.

Hanspeter Schmidli

4. AFIR-Kolloquium, Orlando, 20.–22. April 1994

Die 675 Teilnehmer trafen sich während drei Tagen im Buena Vista Palace in Orlando, Florida. 101 Autoren aus 17 Ländern präsentierten insgesamt 66 Arbeiten. Diese Arbeiten sind in drei imposanten Bänden (von total fast 1600 Seiten) zusammengefasst, welche von der Society of Actuaries erworben werden können ($ 45.– plus 50 % Überseezuschlag).

Hans U. Gerber