

Höhere Fachprüfung für Pensionsversicherungsexperten

Objektyp: **Group**

Zeitschrift: **Mitteilungen / Vereinigung Schweizerischer
Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association des Actuaire
Suisses = Bulletin / Association of Swiss Actuaries**

Band (Jahr): - **(1983)**

Heft 2

PDF erstellt am: **16.07.2024**

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.

\hat{m}_{n+1} der Risikoprämie des Jahres $n+1$ ergibt sich als lineare Funktion aus der vorhergehenden Schätzung \hat{m}_n und der neuen Beobachtung x_n . Solche Formeln sind für die Praxis sehr geeignet: Die neue Prämie ergibt sich aus der bisherigen Prämie mit einer Erfahrungskorrektur auf Grund der neuen Schadenbeobachtung. Der Vortragende erläutert verschiedene Spezialfälle dieses Modells.

Am Schluss seines Vortrages geht Herr Dr. Gisler auf die Zusammenhänge mit der Analyse von Zeitreihen ein. Die Folge der Risikoprämien $\{m_1, m_2, \dots\}$ wird als ARMA-Prozess (autoregressive moving average Prozess) aufgefasst. Auch für diesen Fall sind die Kreditabilitätsschätzer bekannt. Sie sind im allgemeinen von rekursivem Typ höherer Ordnung, d. h. \hat{m}_{n+1} hängt ab von $\hat{m}_n, \hat{m}_{n-1}, \dots, \hat{m}_{n-r}$ und von den r letzten Beobachtungen $x_n, x_{n-1}, \dots, x_{n-r}$. Der Referent weist darauf hin, dass bei Anwendung eines solchen ARMA-Modells für die Beschreibung eines Bestandes die Risikoprämien der einzelnen Verträge um denselben Erwartungswert μ schwanken würden. Gemittelt über eine lange Periode wären die wahren Risikoprämien aller Verträge gleich. Dies dürfte in der Praxis nur selten der Fall sein.

Der Leiter: *F. Bichsel*

Höhere Fachprüfung für Pensionsversicherungsexperten

1 Vorprüfungen 1983

Am 13./14. September sind in Lausanne Vorprüfungen durchgeführt worden.

Zu diesen Prüfungen haben sich

12 Kandidaten für die Vorprüfung Teil A,

19 Kandidaten für die Vorprüfung Teil B

angemeldet. 8 Kandidaten im Teil A sowie 16 Kandidaten im Teil B haben die Prüfung mit Erfolg bestanden.

2 Hauptprüfung 1983

Am 12./13. Oktober 1983 sind sodann in Zürich Hauptprüfungen durchgeführt worden. Alle sechs Kandidaten haben die Diplomprüfung mit Erfolg bestanden. Es sind dies die Herren:

Jean-Pierre Haymoz Dr., Villars-Fribourg;

Werner Koradi, Oberneunforn;

Hannes Menzi Dr., Richterswil;

Martin Niedermann, Flawil;

Edgar Ort, Baar;

Peter Schiess, Zürich.

Die Promotionsfeier fand am 14. Oktober 1983 beim SITC statt, in dessen Räumlichkeiten auch die diesjährigen Hauptprüfungen durchgeführt wurden. Herr Dr. H. Odermatt, Generaldirektor der Schweizer Rück, gratulierte den neuen Pensionsversicherungsexperten zum erfolgreichen Abschluss ihrer mehrjährigen anspruchsvollen Ausbildung. Er wies in seiner Ansprache auf die grosse Bedeutung der Pensionsversicherungsexperten im Rahmen des BVG hin, insbesondere im Zusammenhang mit den erforderlichen Anpassungen der Pensionskassen an die neuen gesetzlichen Erfordernisse. Es nützt nichts, jetzt über die administrativen Probleme zu jammern; wichtig ist, nun mit dem nötigen Sachverstand an die Arbeit zu gehen. Wie wertvoll dabei die Mitarbeit eines kompetenten Pensionsversicherungsexperten ist, hat sich auch bei der Schweizer Rück gezeigt.

Anschliessend übergab Herr Dr. K. Fricker, Präsident der Prüfungskommission, den neuen Diplomierten die schriftlichen Bestätigungen über die erfolgreich abgelegte Prüfung. Er wies darauf hin, dass die diesjährigen Prüfungsergebnisse unterschiedlich gut ausgefallen sind und appellierte an die neuen Pensionsversicherungsexperten, ihrer Weiterbildung die nötige Aufmerksamkeit zu schenken. Seit die Prüfungen 1977 aufgenommen worden sind, haben nun insgesamt 48 Kandidaten das Diplom erworben. Herr Dr. Fricker dankte dem SITC und der Schweizer Rück für die nun schon fast zur Tradition gewordene intensive Unterstützung bei den Kursen und Prüfungen und das immer wieder gewährte Gastrecht sowie dem BIGA, vertreten durch Herrn Dr. P. Meyner, für die stets angenehme Zusammenarbeit.

Der Sekretär der Prüfungskommission:
D. Chable