

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

Band: - (1990)

Heft: 2

Artikel: Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

Autor: Klüppelberg, Claudia

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967245>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist die Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Zeitschriften und ist nicht verantwortlich für deren Inhalte. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern beziehungsweise den externen Rechteinhabern. [Siehe Rechtliche Hinweise.](#)

Conditions d'utilisation

L'ETH Library est le fournisseur des revues numérisées. Elle ne détient aucun droit d'auteur sur les revues et n'est pas responsable de leur contenu. En règle générale, les droits sont détenus par les éditeurs ou les détenteurs de droits externes. [Voir Informations légales.](#)

Terms of use

The ETH Library is the provider of the digitised journals. It does not own any copyrights to the journals and is not responsible for their content. The rights usually lie with the publishers or the external rights holders. [See Legal notice.](#)

Download PDF: 18.10.2024

ETH-Bibliothek Zürich, E-Periodica, <https://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 Punkt 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