XIX. ASTIN-Kolloquium 1986 in Tel-Aviv, Israel

Autor(en): **Straub, E.**

Objekttyp: **Article**

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

Band (Jahr): **- (1986)**

Heft 2

PDF erstellt am: **28.04.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-967050

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

E. STRAUB, Zürich

XIX. ASTIN-Kolloquium 1986 in Tel-Aviv, Israel

Am diesjährigen ASTIN-Kolloquium, das vom 20. bis 24. September im Hotel Hilton in Tel-Aviv stattfand, haben – Begleitpersonen nicht mitgezählt – 187 Mitglieder teilgenommen. Letztes Jahr waren es 225, also wesentlich mehr, wohl vor allem deshalb, weil Biarritz «ASTIN-mässig» zentraler liegt als Tel-Aviv.

Nach dem traditionellen Willkommenscocktail vom Samstagabend wurde das reich befrachtete Programm am Sonntagmorgen gestartet mit der Eröffnung des Kolloquiums durch den ASTIN-Vorsitzenden Jean Lemaire, Bruxelles. Den anschliessenden Gastvortrag hielt Eitan Berglas, Professor für Ökonomie an der Tel-Aviv University und Verwaltungsratspräsident der Hapoalim Bank. Sein Thema hiess: «Inflation, Stabilisierung, Staatsbudget und Kapitalmarkt in Israel». Nach einem historischen Rückblick auf die Wirtschaft seines Landes kam der Referent auf die Tatsache und deren Hintergründe zu sprechen, dass Israels Inflation neuerdings auf unter 20% zurückgegangen ist, und dies ohne spürbare Erhöhung der Arbeitslosigkeit. (Von 1981 bis 1985 betrug die durchschnittliche Jahresinflation 212%, Rekord 1984 mit 335%.)

Die drei angekündigten Themen des wissenschaftlichen Programmes waren:

1. Der Nichtlebenaktuar im Umfeld der Versicherungsgesellschaft
2. Finanzielle Aspekte der Nichtlebenversicherung
3. Die aktuarielle Behandlung von Katastrophenrisiken: Spitzenrisiken und Spezialbranchen.

Die hierzu eingereichten Arbeiten (Verzeichnis nachstehend) wurden in etwa zwei Tagen ausführlich besprochen, so dass noch etwa ein halber Tag für den üblichen Speakers' Corner – wo beliebige Themen aufgegriffen werden können – und die offizielle ASTIN-Jahresversammlung verblieben.

Die Teilnahme am Kolloquium bestätigte, was man schon aufgrund der nachstehenden Liste vermutete, nämlich zum einen, dass Thema 3 nur auf geringes Interesse stiess, und zum anderen, dass zum Thema 1 eine Vielzahl verschiedenster Arbeiten eingereicht wurde, aber eigentlich keine zu dem, was man aufgrund des Titels «The Company Environment of the Non-Life Actuary» erwartet hätte. Bei Thema 1 war vielmehr, wie schon in früheren Kolloquien, vor allem von Reservierungs- und Tarifierungsfragen die Rede im Gegensatz zu Thema 2: «Finanzielle Aspekte», das erst neuerdings, insbesondere was

Solvenzprüfung betrifft, besondere Aktualität erlangt hat. Die Beurteilung der technischen Rückstellungen und der Solvabilität dürfte die Nichtlebenaktuare auch in nächster Zukunft wohl oder übel vermehrt beschäftigen. Dabei ist im Auge zu behalten, dass die Arbeit an der Reservierung um so wichtiger ist als die an der Solvabilität, je grösser das Verhältnis Fremdkapital (= technische Rückstellungen) zu Eigenkapital ist (und dieses kann insbesondere bei einem Rückversicherer bis zu 10:1 ausmachen).
Am Speakers' Corner kamen erneut Eigenschaften von Reservierungsmethoden zur Sprache, dann aber auch Anwendungen der Erfahrungstarifierung in der Lebenskollektiv-Versicherung sowie Untersuchungen über den goodness of fit spezifischer Schadenhöhenverteilungen.
Das sehr eindrückliche soziale Rahmenprogramm des Kolloquiums umfasste Besuche des Diasporamuseums in Tel-Aviv, wo man unter anderem einen Überblick vergangener und noch existierender jüdischer Lebensgemeinschaften erhält, der Altstadt von Jaffa, eines virtuosen Klavierkonzertes an der Tel-Aviv University, des Open Air Colloquium Dinners im Hilton, der historischen Städte Jerusalem und Bethlehem sowie eine Reise durch das Land Galiläa, für jene, die noch ein bisschen länger im immer noch sehr sommerlichen Israel verweilen konnten.

Liste der eingereichten Arbeiten

Thema 1

The Company Environment of the Non-Life Actuary.

H. Bohman/ E. J. Levy:	Diagnostic Tools for Profitability
N. De Pril:	On the Exact Computation of the Aggregate Claims Distribution in the Individual Life Model
Y. Gath/ A. Lubitch:	Reserving in Dental Insurance
F. Harwayne:	A Comparison of Practical Ratemaking Models Paid vs. Incurred Claims & Claims Adjustment Expense Experience
F. J. Q. Sanchez:	Pension Cost of the Management Entity of Pension's Fund
J. N. Stanard:	Bootstrap Estimation of the Variance of Prediction Errors of Loss Reserving Methods

B. Sundt:	Credibility and Old Estimates
B. Sundt:	Some Credibility Regression Models for the Classification of Individual Passenger Car Models
Ch. S. Tapiero:	Executive Insurance System. The Computer Insurance Expert

Thema 2

Financial Aspects of General Insurance.

E. Briys:	On the Theory of Rational Insurance Purchasing in a Continuous Time Model
E. Briys/Y. Kahane/ Y. Kroll:	The Demand for Voluntary Insurance Coverage in the Presence of Compulsory Insurance. Speculative Risk and Risky-Riskless Portfolio Opportunities
S. Coutts/ R. Devitt:	The Assessment of the Financial Strength of Insurance Companies. A Generalised Cash Flow Model
C. D. Daykin/ G. D. Bernstein/ S. M. Coutts/ E. R. F. Devitt/ G. B. Hey/ D. I. W. Reynolds/ P. D. Smith:	The Solvency of A General Insurance Company in Terms of Emerging Costs
Y. Eden/ Y. Kahane:	Moral Hazard and Insurance Market Structure
R. Kaas/ M. J. Goovaerts/ T. Bauwelinckx:	Some Elementary Stop-Loss Inequalities
J. Lemaire/ J.-P. Quairiere:	Chains of Reinsurance Revisited
N. E. Masterson:	Inflation. An Economic Factor in Non-Life Insurance

Thema 3

The Actuarial Treatment of Catastrophes: Target Risks and Special Lines.

B. Ajne/H. Wide:	On the Definition and the Expected Cost of Catastrophe Claims. An Application to the Business Insurance Portfolio of a Direct Insurance Company
A. Ariav/ Y. Kahane/ C. S. Tapiero:	A Pooled Computer Center as a Risk Management Tool

Speaker's Corner

B. Zenwirth/ G. Barnett:	Fundamental Principles of Forecasting and Chain Ladder Model
R. J. Fallquist/ B. A. Jones:	Loss Reserving in the Microcomputer Environment
Y. Kahane/ Ch. S. Tapiero/ L. Jacque:	Concepts and Trends in the Study of Insurer's Solvency
Y. Kahane:	Earthquake Risk and Insurance in Israel – Policy Considerations
Y. Eden/ Y. Kahane:	Optimal Reinsurance Contracts and the Insurance Capacity Problem
E. P. Perez:	Structure de la Prime et Rendements Financiers des Provisions Techniques des Assurances Privées
G. Benktander:	Claims Size Distribution
G. Szpiro:	Risk Aversion in the Not-so-small: beyond Mean and Variance
R. Kaas/ M. J. Goovaerts:	On the use of QUADPACK for the calculation of risk theoretical quantities