

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

Herausgeber: Vereinigung Schweizerischer Versicherungsmathematiker

Band: - (1985)

Heft: 1

Artikel: Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach 1984

Autor: Schnieper, R.

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967059>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist die Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften auf E-Periodica. 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. Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen sowie auf Social Media-Kanälen oder Webseiten ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. [Mehr erfahren](#)

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. La reproduction d'images dans des publications imprimées ou en ligne ainsi que sur des canaux de médias sociaux ou des sites web n'est autorisée qu'avec l'accord préalable des détenteurs des droits. [En savoir plus](#)

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. Publishing images in print and online publications, as well as on social media channels or websites, is only permitted with the prior consent of the rights holders. [Find out more](#)

Download PDF: 05.05.2026

ETH-Bibliothek Zürich, E-Periodica, <https://www.e-periodica.ch>

Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach 1984

An der dritten Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach vom 16. bis 22. September 1984 nahmen 48 Mathematiker, Statistiker und Aktuare aus 12 verschiedenen Ländern teil. Es wurden 32 Vorträge präsentiert, wobei die Wahrscheinlichkeitstheorie und die Numerik den Schwerpunkt der Tagung bildeten. Hauptthemen waren nämlich die Berechnung von Prämien, die Ruinwahrscheinlichkeit und die Berechnung der Gesamtschadenverteilung.

Was das ersterwähnte Thema angeht, so sind die Prämienberechnungsprinzipien nach wie vor ein wichtiges Forschungsgebiet; es wurden aber auch Vorträge über die Bestimmung von Tarifen sowie über spezifische Beispiele von Prämienberechnung gehalten.

Wiederum erwiesen sich Martingale und Diffusionsprozesse als wertvolle Hilfsmittel zur Berechnung, Approximation oder Abschätzung von Ruinwahrscheinlichkeiten. Einer der Vortragenden demonstrierte, dass auch die Entropie-Funktion in diesem Zusammenhang sehr nützlich sein kann.

Unter den Methoden zur Berechnung bzw. Approximation der Verteilung des Gesamtschadens spielten die rekursiven Formeln eine wichtige Rolle.

Auch an dieser Tagung gab es mehrere Beiträge zur Credibility-Theorie.

Was die Anwendung der Statistik und der mathematischen Ökonomie in der Risikotheorie anbelangt, so wurden die Teilnehmer von den Tagungsleitern ermuntert, diese Gebiete in ihrer Forschungsarbeit vermehrt zu berücksichtigen.

Abschliessend sollen noch die zahlreichen informellen Diskussionen erwähnt werden, die am Rand der Tagung stattgefunden haben. Sie ermöglichten einen regen und fruchtbaren Gedankenaustausch.

Im folgenden sind – nach Themen geordnet – die Titel der vorgetragenen Arbeiten aufgeführt:

1. Premium Calculation

- | | |
|-------------|--|
| F. Bichsel | A Case Study about Subjective Probabilities and Moral Hazard |
| H. Bühlmann | Premium Calculation |

H. U. Gerber/O. Deprez	On Convex Premium Calculation Principles
M. Hallin	Premium Rating
E. Kremer	Finite Formulae for the Premium of a General Reinsurance Treaty based on Ordered Claims
J. Lemaire	The New Belgian Bonus-Malus System
A. Reich	A Characterization of the Standard Deviation Principle
J. L. Teugels	Premium Calculation in the Simple Risk Model

2. *Probability of Ruin*

F. Abikhalil	Finite-Time Ruin Models with Discounting and Experience Rating perturbed by a Brownian Motion
J. Haezendonck	The Use of Inversed Martingales in Risk Theory
J. Janssen	Duality Results for Positive and Negative Capital Risk Models
H. R. Lerche	Hitting Distribution of Brownian Motion and Random Walks on Curved Boundaries
V. Mammitzsch	A Short Remark on the Existence of a Non-trivial Zero of the Cumulant Generating Function
A. Martin-Löf	Entropy Estimates for Ruin Probabilities
H. H. Panjer	Direct Calculation of Ruin Probabilities
	Recursive Calculation of Aggregate Claims for the Individual Risk Model
H. R. Waters	Martingales in Life Insurance

3. *Credibility*

M. J. Goovaerts	A Characterization of the Class of Credibility Matrices corresponding to a Certain Class of Discrete Distributions
S. A. Klugman	Robust Credibility
W. Neuhaus	Choice of Statistics in Linear Bayes Estimation
R. Schnieper	Observation-Dependent Credibility Weights
Fl. de Vijlder	The Structure of the Distribution of a Couple of Observable Random Variables in Credibility Theory

4. Approximation of the Aggregate Claim Distribution

P. ter Berg	The Power-Ratio-Gamma Distribution
B. Chan	Recursive Formulae for Compound Difference Distributions
W. R. Heilmann	Transformations of Distributions ¹
T. Pentikäinen	Approximative Evaluation of the Distribution Function of Aggregate Claims
B. Ströter	A Multistage Procedure to Approximate the Aggregate Claim Density

5. Statistical Methods in Risk Theory

O. Borgan	Maximum Likelihood Estimation in Parametric Counting Process Models with Applications to Insurance
F. Cederby	An Empirical Study of Claims arising from Water Damages in a Portfolio of Comprehensive Policies for Dwellings and Single Family Houses
Ch. Hipp	Efficient Estimation in the Presence of Incidental Parameters
R. B. Miller	Multivariate Time Series Models for Age Specific Fertility Rates
J. Paris	Repeated Measures: Its Applications to Insurance

6. Influence of Investment Policies in Risk Theory

H. Müller	Investment Policies and Reinsurance for Pension Funds
-----------	---

¹ Siehe dieses Heft, Seite 57