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: 23.11.2025

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

R.SCHNIEPER, Winterthur

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 Reinsuran-

ce 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 Expe-

rience 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 Indivi-

dual 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 Distribu-

tions

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 Obser-

vable 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 Distribu-

tions

W. R. Heilmann Transformations of Distributions¹

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 Coun-

ting Process Models with Applications to Insurance

F. Cederby An Empirical Study of Claims arising from Water Dama-

ges in a Portfolio of Comprehensive Policies for Dwellings

and Single Family Houses

Ch. Hipp Efficient Estimation in the Presence of Incidental Para-

meters

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