

Zeitschrift: Mitteilungen / Schweizerische Aktuarvereinigung = Bulletin / Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries

Herausgeber: Schweizerische Aktuarvereinigung

Band: - (1996)

Heft: 2

Artikel: 27. ASTIN-Kolloquium, 1. bis 5. September 1996, Kopenhagen

Autor: Debonnaire, Hervé

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-551130>

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: 03.02.2026

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

27. ASTIN-Kolloquium, 1. bis 5. September 1996, Kopenhagen

Das 27. ASTIN-Kolloquium fand vom 1. bis zum 5. September in Kopenhagen statt. Der Präsident des Organisationskomitees war L. Halling und der Präsident des wissenschaftlichen Komitees O. Hesselager.

Rund 150 Aktuare nahmen an diesem Kolloquium teil, welches wieder interessante Gespräche zwischen Praktikern und Akademikern ermöglichte.

Neben den wissenschaftlichen Vorträgen wurden auch verschiedene kulturelle Aktivitäten angeboten, zum Beispiel ein Abend im königlichen Theater und ein Tagesausflug in den Norden Seelands. Für die Begleitpersonen wurde ein kulturelles Programm organisiert, welches ermöglichte, Kopenhagen und seine Umgebung zu entdecken.

Das Organisationskomitee hatte drei Hauptreferenten eingeladen: S. Lowe, Prof. N. Keiding und A. Kristiansen. S. Lowe legte dar, wie verfeinerte Modelle für Naturkatastrophen und Finanzrisiken den Aufbau eines weniger exponierten und rentableren Portfolios und eine bessere Benützung des Kapitals ermöglichen. Er illustrierte seinen Vortrag mit seinen Erfahrungen als Konsultant einer Rückversicherung in Bermuda. N. Keiding ist Professor an der Abteilung Biostatistik an der Universität Kopenhagen. Er sprach darüber, wie die Cox-Regression für die Bestimmung der Schadenfrequenz und für die Quotierung in der Nicht-Leben-Versicherung angewendet werden könnte. A. Kristiansen stellte das norwegische gesetzliche System für die Bestimmung der minimalen technischen Reserven vor.

Die eingereichten Arbeiten wurden in drei Hauptthemen eingeteilt:

- Katastrophen-Risiken,
- Profitabilität,
- Solvabilität.

Zum Thema Katastrophen-Risiken wurden sechs Artikel vorgestellt. Die Modellierung von Derivaten für Risikoverfahren zeigt Ähnlichkeiten zwischen Finanzmathematik und Versicherungsmathematik (A. Barfod & D. Lando). Die empirische Mean-Residual-Lifetime-Funktion hängt sehr stark von den Grossrisiken ab (M. Rytgaard). Eine einfache und trotzdem zuverlässige Berechnung der Risikoprämie für eine XL-Deckung wird von M. Rytgaard vorgestellt. Die Kreditversicherung kann nicht durch klassische Modelle, welche für die Katastrophenrisiken gültig sind, beschrieben werden (T. Pentikäinen, Y. Romppainen). In dem Artikel von J. Breen und E. Kromme werden Simulationstechniken für die Stop-Loss-Tarifierung gezeigt.

Zum zweiten Thema, Profitabilität, wurden nicht weniger als sechzehn Artikel vorgestellt. Es wird eine Methode vorgeschlagen, um die Anzahl Kriterien in einer multivariaten Statistik zu reduzieren (L.Serant & B.Bailleul). Verschiedene Bonus-Malus-Systeme und ihre Eigenschaften werden gezeigt (B.Berliner & Y.Babad, G.Coene & L.Doray, J.Pinquet). H.Bühlmann und A.Gisler modifizieren Hachemeisters Regressionsmodell für Kredibilität. R.Kaas, D.Dannenburg und M.Goovaerts beweisen eine Verallgemeinerung des Satzes von Jewell zur Kredibilitätstheorie. In dem Artikel von W.Neuhaus wird eine optimale Schätzung des Bayes-Schätzers unter linearen Bedingungen vorgeschlagen. Auch ein praktisches Modell für die Schätzung von Risiken (D.Skurnick & M.Grandisson) und eine Strategie für eine optimale Rückversicherungsdeckung (P.De Angelis & N.Ettore D'Ortona) werden vorgestellt. J.Dhaene, G.Willmot und B.Sundt zeigen die Berechnung der Verteilungsfunktionen und Stop-Loss-Transformierten mit Hilfe einer Rekursion. Die Gesamtschaden-Verteilung kann mit EXCEL sehr einfach berechnet werden (C.Hipp). Mehrere Beiträge zur Risiktheorie werden von W.Hürlimann geliefert. Eine Methode für die Reservierung von aufeinanderfolgenden Layern in der XL-Rückversicherung wird von G.Taylor gezeigt. Auch werden einige Artikel vorgestellt, welche die Lebensversicherung betreffen (J.Spreeuw, A.Deis, J.Nielsen & P.Voldsgaard).

Das letzte Thema war Solvabilität. D.Dickson und A.Egídio dos Reis betrachten den Effekt der Zinsen in der Ruintheorie. Verschiedene Beiträge zur IBNR (Incurred But Not Reported)- und RBNS (Reported But Not Settled)-Berechnung werden geliefert (S.Haastrup & E.Arjas, E.Kremer, F.Larsen & S.Monty & C.Clemmensen, B.Sandqvist). Im Artikel von C.Larson wird die Anwendung der Bootstrap-Methode zur Berechnung der Schadenreserven beschrieben. J.Paulsen und H.Gjessing benützen Integro-differential-Gleichungen in der Ruintheorie.

Während des sogenannten «Speaker's Corner» stellte A.Gisler seinen Artikel «Bonus-Malus and Tariff Segmentation» vor, und S.Wang sprach über seinen Artikel «Implementation of PH-Transforms in Ratemaking». H.Schmitter ergriff die Gelegenheit, ein Problem aus der Praxis aufzuwerfen.

Hervé Debonnaire

Konstituierung des Vorstands 1996–1997 sowie aller Kommissionen und Ausschüsse *

1. *Vorstand*

Präsident	Prof. Dr. J. Kupper
Vizepräsident	Prof. Dr. H. Lüthy
Sekretär	P. Diethelm
Quästor	Dr. R. Zufferey
Bibliothekar	P. Streit
Vorsitzender der Redaktion der «Mitteilungen»	Prof. Dr. H. U. Gerber
Präsident der Prüfungs- kommission	Dr. E. Kuhn
Vorsitzender Ausschuss	
1. und 2. Säule	A. Schneiter
Präsident Gemischte Kommission	R. Crelier
Beisitzer	Prof. Dr. P. Embrechts
	Dr. K. Matt

2. *Sekretär des Präsidenten*

Dr. H. Tobler

3. *Redaktionskommission der «Mitteilungen»*

Prof. Dr. H. U. Gerber (Vorsitz)
Frau Dr. M.-Th. Kohler
Dr. H. Schmitter

4. *Vorstandsausschuss für Fragen der 1. und 2. Säule*

A. Schneiter (Vorsitz)
Dr. E. Kuhn
Prof. Dr. J. Kupper
Dr. K. Matt
Dr. R. Zufferey

* Seit Ende September 1996

5. *Arbeitsgruppen*
(von der Mitglieder-
versammlung eingesetzt)

Personalversicherung	D. Mazouer	Dr. E. Kuhn
Datenverarbeitung	Dr. O. Hauger	R. Crelier
ASTIN	Prof. Dr. A. Dubey	Prof. Dr. H. U. Gerber

6. *Arbeitsgruppen/Kommissionen*
(vom Vorstand eingesetzt)

Organisation SAV	P. Diethelm
Ausbildung und Aufnahme von Aktuaren	Dr. W. Kreis Prof. Dr. J. Kupper
Internationale Kontakte	Dr. M. Chuard

7. *Arbeitsgruppe Versicherungstechnik des BPV*

Leitung	Prof. Dr. J. Kupper
Vertreter SAV	Prof. Dr. A. Dubey
	Dr. K. Matt

8. *Prüfungskommission für Pensionsversicherungsexperten*

Präsident	Dr. E. Kuhn
Sekretär	G. Caviezel

Präsidenten der Fachgruppen:

- Hauptprüfung M.-A. Röthlisberger
- Versicherungsmathematik P. Schiess
- Recht und Sozialversicherung J. Keller

9. *Gemischte Kommission*

Präsident	R. Crelier
Vertreter SAV	Frau J. Laich
Kammer	Dr. U. Wehrli

10. *Standeskommission*

Präsident	P. Christe
Mitglieder	Prof. Dr. Ph. Maeder P. Möschler Dr. G. Scheidegger Prof. Dr. M. Köhler Frau F. Wermeille
Ersatzmitglieder	K. Hösli Dr. G. Rey

11. *SAV-Frauen*

Kontaktpersonen	Frau Dr. P. Casal Frau D. Cleuvenot
-----------------	--

12. *Fonds zur Förderung der Versicherungsmathematik*

Präsident	Prof. Dr. H. U. Gerber
Mitglieder	Prof. Dr. M.-H. Amsler Prof. Dr. P. Embrechts Prof. Dr. H. Lüthy Prof. Dr. E. Straub Dr. R. Zufferey

13. *Vertretung in der AAI (Association Actuarielle Internationale)*

Vizepräsident	Prof. Dr. J. Kupper
Sekretär	Dr. E. Kuhn
Landeskorrespondent	Dr. K. Matt

14. *Vertretung im FIAA (Forum International des Associations Actuarielles)*

Offizieller Delegierter SAV	Dr. E. Kuhn
Vertreter in Kommissionen:	
– Education Subcommittee	Prof. Dr. H. U. Gerber
– International Accountants Standards Subcommittee	Dr. U. Wehrli

15. Vertretung in der GC (Groupe Consultatif)

Offizieller Delegierter SAV Dr. M. Chuard

Vertreter in Kommissionen:

- | | |
|--|------------------------|
| – Insurance Committee | Dr. M. Chuard |
| – Pensions Committee | K. Niklewicz |
| – Education Committee | Prof. Dr. H. U. Gerber |
| – Financial Committee | Frau P. Wildemann |
| – Freedoms and General
Purposes Committee | Dr. F. Lock |

