**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: 20.11.2025** 

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 Risikotheorie 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

<sup>\*</sup> Seit Ende September 1996

5. Arbeitsgruppen Leitung Verbindung (von der Mitglieder- zum Vorstand

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 Leitung

(vom Vorstand eingesetzt)

Organisation SAV P. Diethelm

Ausbildung und Aufnahme Dr. W. Kreis

von Aktuaren 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

VersicherungsmathematikRecht und SozialversicherungJ. Keller

9. Gemischte Kommission

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

10. Standeskommission Leitung

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. Amgler

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 CommitteePensions CommitteeDr. M. ChuardK. Niklewicz

Education CommitteeFinancial CommitteeFrau P. Wildemann

Freedoms and General

Purposes Committee Dr. F. Lock

