

Literatur-Rundschau

Objekttyp: **BookReview**

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

Band (Jahr): - **(1998)**

Heft 2

PDF erstellt am: **21.06.2024**

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.

C. Literatur-Rundschau

Abschiedsvorlesung von Herrn Professor Hans Bühlmann vom 2. Juli 1997

Es freut uns, Ihnen mitteilen zu können, dass die Abschiedsvorlesung unseres Ehrenpräsidenten zum Thema «Mathematische Paradigmen der Finanzwirtschaft» als Kleine Schriften Nr. 34 der ETHZ publiziert worden ist. Sie kann direkt bei der ETH, Zentrum, Abteilung Öffentlichkeitsarbeit, 8092 Zürich, bezogen werden.

Die Redaktionskommission

H. Wolthuis and M.J. Goovaerts eds.: *Reserving and Solvency in Insurance in the EC*, Institute of Actuarial Science and Econometrics, Universiteit van Amsterdam, Amsterdam, 1997, 281 pp., ISBN 90-802117-6-1

This book is a reedition of a text published in 1993 by CAIRE that gives results of a study carried out in the framework of an EC Spes project entitled „Harmonization of reserving in insurance by means of actuarial, econometrical and statistical methods“.

The first part of the book summarized the responses to a questionnaire on reserving and solvency which was sent to all EC countries. It deals with the following questions.

- the different reserves and their calculation methods, used in life insurance,
- the technical provision in non-life insurance,
- the reserving methods used in pension funds, and
- solvency measures and the use of equilization reserve.

The second part contains papers on reserving in Spain, Belgium, the Netherlands, France, United Kingdom, Germany, Denmark, Portugal and Italy that were especially written for this purpose.

Markus Buchwalder

Harry H. Panjer, ed.: *Financial Economics with Applications to Investments, Insurance and Pensions*, The Actuarial Foundation, Schaumburg, Illinois 60173, 1998, 669 pp., ISBN 0-938959-48-4

This textbook is the result of a partnership with Lincoln National Corporation and a team of ten authors: Phelim P. Boyle, Samuel H. Cox, Daniel Dufresne, Hans U. Gerber, Heinz H. Müller, Hal W. Pedersen, Stanley R. Pliska, Michael Sherris, Elias S. Shiu, Ken Seng Tan. It presents key concepts in financial economics and discusses applications of these concepts to financial management. An overview of the covered aspects of financial economics is given by the table of contents:

- Chapter 1: Financial markets
- Chapter 2: Derivative Securities
- Chapter 3: Interest Rate Risk and Immunization
- Chapter 4: Equilibrium Pricing
- Chapter 5: No-Arbitrage Pricing Theory
- Chapter 6: Options and Other Derivatives
- Chapter 7: Term Structure Models
- Chapter 8: Portfolio Selection
- Chapter 9: Investment Return Models
- Chapter 10: Option Pricing in Continuous Time
- Chapter 11: No-Arbitrage Pricing Theory – Advanced
- Technical Appendix (Probability Background)

Exercises are included at the end of each chapter. The book is completed with a extensive index.

The book can be ordered directly from the Society of Actuaries (PO Box 95668, Chicago, IL 60694, USA, fax 001 8477063599, phone 001 8477063526). The price is \$ 95 plus a 50% surcharge for oversea shipping. Prepayment in the form of check/moneyorder or credit card is required. Order forms can be obtained on the internet at the following address: <http://www.actuarialfoundation.org/economic.html>

Marie-Thérèse Kohler

Philippe Chuard: *Introduction aux mathématiques actuarielles de l'assurance sur la vie*, Ph. Chuard, CH-1009 Pully, 1997, 111 p.

Cette introduction destinée à un large public constitue une bonne orientation auprès d'étudiants futurs en actuariat. Les bases des mathématiques actuarielles classiques de l'assurance sur la vie, telles que les fonctions financières, les fonctions biométriques et les fonctions actuarielles primes, réserves et valeur actuelle des prestations futures, sont présentées de manière simple et rigoureuse. Cette brochure aborde également des notions moins mathématiques comme le compte de pertes et profits et le compte de résultat.

Marie-Thérèse Kohler

Die Redaktionskommission macht auch auf folgende Bücher aufmerksam:

H. Wolthuis and R. Bruning: *Levensverzekeringwiskunde Deel 1*, Instituut voor Actuarie en Econometrie, Universiteit van Amsterdam, Amsterdam, 1996, 369 pp., ISBN 90-802117-4-5

H. Wolthuis: *Riemann-Stieltjesintegratie en Toepassingen in de Levensverzekeringwiskunde*, Instituut voor Actuarie en Econometrie, Universiteit van Amsterdam, Amsterdam, 1997, 143 pp., ISBN 90-802117-5-3

Die Redaktionskommission

