

**Zeitschrift:** Mitteilungen / Schweizerische Vereinigung der  
Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association Suisse des  
Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries

**Herausgeber:** Schweizerische Vereinigung der Versicherungsmathematiker

**Band:** - (1990)

**Heft:** 2

  

**Artikel:** Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

**Autor:** Klüppelberg, Claudia

**DOI:** <https://doi.org/10.5169/seals-967245>

### **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:** 01.07.2025

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

## Tagung über Risikotheorie in Oberwolfach

An der Tagung, die vom 16. bis 22. September 1990 unter Leitung der Professoren H. Bühlmann (Zürich), P. Embrechts (Zürich), H. U. Gerber (Lausanne) und J. L. Teugels (Leuven) stattfand, nahmen rund 50 Wissenschaftler und Praktiker teil. In 36 Vorträgen wurden die neuesten Forschungsergebnisse aus der Versicherungsmathematik vorgestellt.

Die wichtigsten Themenschwerpunkte waren:

- a) Verallgemeinerte Modelle von Risikoprozessen
- b) Statistische Probleme in Verbindung mit dem Risikoprozess
- c) Vergleich von Modellen für Kapitalmärkte und Versicherungsmärkte
- d) Prämienberechnungsprinzipien
- e) Stochastische Modelle in der Lebensversicherungsmathematik.

Vorträge zu Punkt a) behandelten Möglichkeiten zur Modellierung des Risikoprozesses unter Berücksichtigung von Kapitalbeschaffungsmöglichkeiten, der Verzinsung der freien Reserven und Inflation. Unter Punkt b) wurden sowohl statistische als auch numerische Schätzverfahren für die Schadensverteilung und den Lundbergkoeffizienten vorgestellt. Zu Thema c) wurden Anwendungen des Black-Scholes-Modells diskutiert und seine Approximation durch diskrete Modelle, wie z. B. das Cox-Ross-Rubinstein-Modell, untersucht. Hauptpunkte unter d) bildeten die Prämienanpassung an die Schadensentwicklung und eine robuste Parameterschätzung in der Credibility-Theorie. Unter e) wurden z. B. stochastische Modelle für Zinsstrukturen innerhalb der Lebensversicherungsmathematik diskutiert.

Am Rande der Tagung gab es zahlreiche informelle Diskussionen, die auf einen lebhaften Gedankenaustausch auch ausserhalb des offiziellen Tagungsprogramms hinweisen.

*Claudia Klüppelberg, Zürich*