

Peter Hieber und Matthias Scherer

## Bericht zur Konferenz „Insurance: Mathematics and Economics 2019“

Vom 10. bis 12. Juli 2019 fand in München der internationale Kongress „Insurance: Mathematics and Economics (IME)“ statt; im 23. Jahr dieser renommierten Serie erstmals in Deutschland. Veranstaltet wurde die Konferenz vom Lehrstuhl für Finanzmathematik der Technischen Universität München. Eröffnet wurde sie mit Grußworten von Prof. Dr. Wolfgang A. Herrmann (Präsident der TUM) und Mark Klein (Chief Digital Officer ERGO Group). In seiner Ansprache betonte Präsident Herrmann den hohen Stellenwert der versicherungsmathematischen Forschung und Lehre am Standort München. Mark Klein gab einen Einblick in die umfangreichen Digitalisierungsprojekte der ERGO Group. Unisono wurde der Erfolg der Kooperation der TUM mit der ERGO Group im Rahmen des *ERGO Center of Excellence in Insurance* hervorgehoben.

Besucht wurde die Konferenz von etwa 400 Teilnehmern aus Wissenschaft und Praxis, fast 300 Teilnehmer waren selbst als Vortragende aktiv. Beeindruckend war die Internationalität der Teilnehmer sowie deren wissenschaftliche Provenienz; von angewandter bis theoretischer Versicherungsmathematik wurden Vorträge eingereicht, die grob in die Themenbereiche Data Science in Insurance, Life and Non-Life Insurance, Quantitative Risk Management, Asset Liability Management und Emerging Risks eingeteilt wurden. Dies resultierte in einem sehr abwechslungsreichen Vortragsprogramm, organisiert in neun parallelen Vortragssträngen. Die DGVMF wurde durch Ralf Korn (TU Kaiserslautern) in einem eigenen Vortragsblock („DGVMF-Session“) vertreten. Ziel dieses Blocks war es, vor allem Nachwuchswissenschaftlern eine Plattform für ihre Forschungsergebnisse zu geben.

Die ungeteilte Aufmerksamkeit wurde den eingeladenen Key-Note-

Speakern zuteil. Als erster Sprecher referierte Paul Embrechts (ETH Zürich) über „The Fundamental Theorem of Quantitative Risk Management“. In seinem Vortrag wies er insbesondere auf die Gefahr im Risikomanagement hin, aufgrund mathematischer Einfachheit unzutreffende Verteilungsannahmen hinzunehmen. Sehr unterhaltsam schilderte Moshe A. Milevsky (York University Toronto) „500 Years of Annuity Mispricing“ welchen Irrtümern die Forschung und Praxis in der Vergangenheit aufgesessen ist und was wir noch heute daraus lernen können. Insbesondere forderte er die Industrie auf, die Interessen der Kunden besser aufzugreifen und Produkte so zu gestalten, dass diese Interessen möglichst gut abgedeckt werden.

Einen Überblick von der Entstehung bis hin zur aktuellen Forschung der stochastischen Programmierung in der Portfoliooptimierung gab William T. Ziemba (University of British Columbia and London School of Economics) in seinem Vortrag „The stochastic programming approach to asset-liability and wealth management“. Über die (deutlich jüngere) Geschichte der Abhängigkeitsmodellierung durch Vine Copulas berichteten zwei der wichtigsten Protagonisten auf diesem Gebiet: Kjersti Aas (Norwegian Computing Center) und Claudia Czado (Technische Universität München) im gemeinsamen Vortrag „Vine copulas in finance and insurance“. Sehr interessante philosophische Überlegungen zur Bedeutung der Diskontierung hinsichtlich eines Wohlstandstransfers zwischen den Generationen machte Christian Gollier (Toulouse School of Economics) in seinem Referat „Facing our responsibilities toward future generations under deep uncertainties: Discounting and climate change“. Den abschließenden Hauptvortrag gab Hansjörg Albrecher (Université de Lausanne). Er referierte unter dem

Titel „Models in Non-Life Insurance: from the casting to the catwalk“ über aktuelle Entwicklungen im Bereich der Modellierung von Schadensereignissen.

Neben dem umfangreichen wissenschaftlichen Programm blieb auch Zeit für sozialen Austausch sowie einen kleinen Eindruck von München. Dafür wurde eine nächtliche Stadtführung durch die Münchner Innenstadt und ein klassisch bayrisches Abendessen im Restaurant Seehaus im Englischen Garten angeboten. Großes Lob gab es für das Catering durch das Veranstaltungshotel Sheraton Munich Arabellapark. Überrascht wurden die Teilnehmer zudem von der Premiere des Dokumentationsfilms über den Mathematiker und Pazifisten Emil J. Gumbel, der im November 2019 im SWR zu sehen sein wird.

Ein Höhepunkt des Kongresses war die feierliche Verabschiedung von Rob Kaas als Managing Editor der Zeitschrift *Insurance: Mathematics and Economics (IME)*. Roger Laeven und Hans-Ulrich Gerber gaben einen unterhaltsamen und sehr persönlichen Rückblick auf sein langjähriges Engagement für die Zeitschrift. Nach mehr als zwei Jahrzehnten wird Rob Kaas zum Jahresende sein Amt als Managing Editor niederlegen.

In der Abschlusszeremonie bedankte sich das Organisationsteam (Lexuri Fernández, Bettina Haas, Yevhen Havrylenko, Peter Hieber, Matthias Scherer, Lorenz Schneider, Büsra Temoçin, Rudi Zagst) bei ihren Gästen und gab den Staffelstab an die Organisatoren der kommenden IME Konferenz 2020 in Montreal weiter. Umfangreiches Material zur Konferenz kann von der offiziellen Webseite ([www.mathfinance.ma.tum.de/ime-2019/program](http://www.mathfinance.ma.tum.de/ime-2019/program)) geladen werden. Über die neue aktuarielle Videoplattform [www.actuview.com](http://www.actuview.com) sind zudem ausgewählte Vorträge frei abrufbar.



Vor der Eröffnung, v. l. n. r.: Mark Klein (ERGO), Wolfgang A. Herrmann, Rudi Zagst, Matthias Scherer (Technische Universität München).  
Fotograf: Sebastian Kissel, TUM



Einer von fast 300 Vorträgen auf der diesjährigen IME.  
Fotografin: Astrid Eckert, TUM



Vor dem ersten Hauptvortrag, v. l. n. r.: Matthias Scherer (Technische Universität München), Paul Embrechts (ETH Zürich), Peter Hieber (Technische Universität München).  
Fotograf: Sebastian Kissel, TUM



Rob Kaas wird für seine langjährige Arbeit als IME Managing Editor geehrt, v. l. n. r.: Rob Kaas (Universität Amsterdam), Roger Laeven (Universität Amsterdam).  
Fotografin: Astrid Eckert, TUM



Zwei der insgesamt sieben Hauptredner Moshe Milevsky (Mitte, York University Toronto) und William Ziemba (rechts, University of British Columbia and London School of Economics).  
Fotograf: Sebastian Kissel, TUM



Hansjörg Albrecher (Université de Lausanne) referiert im letzten Hauptvortrag. Fotografin: Astrid Eckert, TUM



Registrierung für die Konferenz.  
Fotografin: Astrid Eckert, TUM



Gruppenfoto der IME-Editoren bei der diesjährigen Konferenz.  
Fotografin: Astrid Eckert, TUM



Fast 400 Teilnehmer aus aller Welt nahmen an der IME 2019 teil, vorne v. l. n. r.: An Chen (Universität Ulm), Ralf Korn (TU Kaiserslautern), Alfred Müller (Universität Siegen), Kjersti Aas (Norwegian Computing Center).  
Fotograf: Astrid Eckert, TUM



Das Organisationskomitee der IME 2019.  
Fotograf: Sebastian Kissel, TUM