

## 中国精算研究院科研成果荣获2012年Charles A. Hachemeister奖

[发表时间]: 2012-08-30 [来源]: 中国精算研究院 [浏览次数]:

北美非寿险精算协会(Casualty Actuarial Society, 简称CAS)评奖委员会将2012年Charles A. Hachemeister奖授予中央财经大学中国精算研究院池义春副研究员和陈建成教授共同完成的文章“Optimal Reinsurance Under VaR and CVaR Risk Measures: A Simplified Approach”, 并将于今年10月1日在墨西哥城举办的第41届ASTIN论坛上宣读获奖者名单。

今年, David Cummings主席领导的评奖委员会, 依据研究成果对行业的影响性、实用性、原创性、可读性和完整性等标准, 从70多篇优秀文章中遴选出这篇获奖论文。在这篇论文中, 作者讨论了VaR和CVaR监管风险度量对再保险的影响, 分析了在不同分出函数约束下的最优再保险策略, 得出了在VaR风险度量下止损再保险并不总是最优的。这些发现有助于人们重新思考VaR广泛应用于偿付能力监管和资本建模中的适当性。

CAS于1993年创立Hachemeister奖, 为了表彰Charles A. Hachemeister先生在非寿险研究领域做出的重大贡献和为建立CAS和ASTIN之间的更紧密联系所付出的巨大努力, 同时也为了进一步推动国际上财产险和意外险的研究。只有前一年发表在学术期刊ASTIN Bulletin或者前一年在ASTIN和AFIR论坛上报告的文章才允许参评这个奖项。

相关链接:

1. <http://www.casact.org/about/index.cfm?fa=hach>
2. <http://www.casact.org/press/index.cfm?fa=viewArticle&articleID=2044>
3. [http://www.actuaries.org/LIBRARY/ASTIN/vol41no2/Chi\\_Tan.pdf](http://www.actuaries.org/LIBRARY/ASTIN/vol41no2/Chi_Tan.pdf)

编辑: 孙颖

版权所有: 中央财经大学 学院南路校区地址: 北京市海淀区学院南路39号 邮编: 100081

沙河校区地址: 北京市昌平区沙河高教园区 邮编: 102206

(C)Copyright 2006 www.cufe.edu.cn All Rights Reserved