

Erratum zu: Modellvalidierung mit Hilfe von Quantil-Quantil-Plots unter Solvency II

Dietmar Pfeifer

© Springer-Verlag GmbH Deutschland, ein Teil von Springer Nature

Erratum zu:
ZVersWiss 2019
<https://doi.org/10.1007/s12297-019-00451-y>

Die Tab. 6, Seite 324 ist in Bezug auf die p -Werte des Shapiro-Wilk-Tests wie folgt zu korrigieren (Werte sind in fetter Schrift dargestellt).

Es zeigt sich, dass sich die p -Werte aller Verfahren deutlich unterscheiden, mit der größten Diskrepanz bei den Sparten VGV, VHV und Allgemeine Haftpflicht. Bei den Sparten Sach privat und VGV lehnen alle Tests bei einer Fehlerwahrscheinlichkeit 1. Art von 1% die Nullhypothese ab. Bei der Sparte Sach gesamt würde die Nullhypothese bei einer Fehlerwahrscheinlichkeit 1. Art von 5% mit dem Korrelationstest und dem Shapiro-Wilk-Test knapp abgelehnt, mit dem Lilliefors-Test dagegen nicht. Bei den Sparten VHV, Unfall, Rechtsschutz, Gewerbe und Allgemeine Haftpflicht wird die Nullhypothese bei einer Fehlerwahrscheinlichkeit 1. Art von 10% unter allen Tests nicht verworfen.

Die Online-Version des Originalartikels ist unter <https://doi.org/10.1007/s12297-019-00451-y> zu finden.

D. Pfeifer (✉)
Institut für Mathematik, Schwerpunkt Versicherungs- und Finanzmathematik, Carl von Ossietzky
Universität Oldenburg, Oldenburg, Deutschland
E-Mail: dietmar.pfeifer@uni-oldenburg.de

Tab. 6 Testgrößen und *p*-Werte

Sparte	Korrelationstest		Lilliefors-Test		Shapiro-Wilk-Test	
	T_n	<i>p</i> -Wert (in %)	d_n	<i>p</i> -Wert (in %)	W_n	<i>p</i> -Wert (in %)
Sach gesamt	2,8831	4,32	0,1743	15,17	0,8955	4,76
Sach privat	2,1064	0,09	0,2732	0,11	0,7758	0,05
VGW	2,1378	0,11	0,2481	0,47	0,7785	0,55
VHV	3,3515	17,95	0,1083	83,00	0,9329	22,00
Unfall	3,5261	26,76	0,1670	19,73	0,9280	18,08
Rechtsschutz	4,6539	91,30	0,0936	94,59	0,9763	88,02
Gewerbe	4,1377	67,08	0,1268	61,19	0,9665	71,16
Allgemeine Haftpflicht	3,9443	64,96	0,1795	24,90	0,9395	40,59