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

Herausgeber: Schweizerische Aktuarvereinigung

Band: - (2000)

Heft: 1

Artikel: Festkolloquium anlässlich des 70. Geburtstages von Professor Hans Bühlmann

Autor: Göing-Jaeschke, Anja

DOI: https://doi.org/10.5169/seals-967295

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: 13.07.2025

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

A. Allgemeine Mitteilungen

Festkolloquium anlässlich des 70. Geburtstages von Professor Hans Bühlmann

Zu Ehren von Prof. Hans Bühlmann fand am 28. Januar 2000 anlässlich seines 70. Geburtstages ein Kolloquium an der ETH Zürich statt. Als eingeladene Redner sprachen Prof. Ragnar Norberg von der London School of Economics und Prof. Phelim Boyle von der University of Waterloo, Kanada. Zum Ende des Kolloquiums wurde der 23. Walter-Saxer-Versicherungspreis an Peter Blum und Roger Kaufmann von der ETH Zürich verliehen.

Nach der herzlichen Begrüssung des Ehrengastes eröffnete Prof. Paul Embrechts das Festkolloquium mit Informationen über aktuelle Entwicklungen des von Prof. Hans Bühlmann über lange Jahre entscheidend geprägten Departements Mathematik an der ETH Zürich. In diesem Zusammenhang machte er die Anwesenden auf die Web-Seite afshapiro.com aufmerksam, von der ein Video-Vortrag von Prof. Hans Bühlmann über «Mathematical Paradigms in Insurance and Finance» heruntergeladen werden kann.

In dem sich anschliessenden ersten Festvortrag beschrieb Prof. Ragnar Norberg auf detaillierte und unterhaltsame Weise die Geschichte der Aktuarswissenschaft. Dabei ging er bis in die Römerzeit zurück und zeigte die versicherungsmathematische Entwicklung über die Renaissance hin bis zum 20. Jahrhundert anhand vieler Portraits einzelner Gelehrtenpersönlichkeiten. Von der Kollektiven Risikotheorie Filip Lundbergs und Harald Cramèrs zu Beginn des 20. Jahrhunderts wurde der Bogen bis zur massgeblich von Prof. Hans Bühlmann geprägten Credibility Theorie geschlagen. Prof. Ragnar Norberg machte darauf aufmerksam, dass viele der angesprochenen Entwicklungen von Prof. Hans Bühlmann im Lehrbuch «Mathematical Methods in Risk Theory» in einer vereinheitlichten Denkweise dargestellt worden sind. Dieses Buch hat die moderne Risikotheorie nachhaltig beeinflusst.

Prof. Phelim Boyle diskutierte die Gemeinsamkeiten und Unterschiede von Versicherungs- und Finanzwissenschaft. Anhand von anschaulichen Beispielen zeigte er die Ideen der modernen Finanzmathematik, wie das Bewerten und «hedgen» von Optionen, das No-Arbitrage-Prinzip und Bewertung in vollständigen und unvollständigen Märkten. Weiterhin sprach er Probleme im Risikomanagement an und betonte, dass häufig bei Renditebetrachtungen die Risiken nicht adäquat gemessen

werden. Seine Ausführungen veranschaulichte er an mehreren Beispielen, u.a. erklärte er die Risiken von «Hedge Funds». Dabei wird ein grosses Volumen an «out-of-the-money»-Optionen geschrieben. Verhält sich der Markt «normal», gewinnt man den Optionspreis; das Risiko scheint klein, die Performance sehr gut. Endet aber die Option bei sehr grossen Marktbewegungen «in-the-money», ist der Verlust sehr hoch. Es gelang Prof. Phelim Boyle in seinem Vortrag, alle entscheidenden Aspekte anzusprechen und auf den Punkt zu bringen.

Im Anschluss an die beiden Festvorträge fand die Verleihung des Walter-Saxer-Versicherungspreises statt. In seiner Ansprache ging Prof. Josef Kupper als Mitglied des Konsortiums auf die Geschichte des Walter-Saxer-Versicherungspreises ein. Danach wurden die Arbeiten der beiden Preisträger von ihren jeweiligen Betreuern vorgestellt. Prof. Rüdiger Frey würdigte die Arbeit von Peter Blum über Simulationsstudien von Hochfrequenz-Daten. Die Arbeit von Roger Kaufmann über Dynamic Financial Analysis (DFA) stellte Prof. Paul Embrechts vor. Die Preise wurden den beiden Preisträgern von Dr. Michael Koller überreicht.

Beim anschliessenden Apéro ergab sich für die Anwesenden die Möglichkeit, die im Kolloquium aufgeworfenen Themen weiterzudiskutieren.

Anja Göing-Jaeschke