

Internationale Sommerschule 1996

Autor(en): **Kreutzberger, Eva**

Objektyp: **Article**

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

Band (Jahr): - **(1996)**

Heft 2

PDF erstellt am: **05.08.2024**

Persistenter Link: <https://doi.org/10.5169/seals-551129>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Inhalten der Zeitschriften. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern. Die auf der Plattform e-periodica veröffentlichten Dokumente stehen für nicht-kommerzielle Zwecke in Lehre und Forschung sowie für die private Nutzung frei zur Verfügung. Einzelne Dateien oder Ausdrucke aus diesem Angebot können zusammen mit diesen Nutzungsbedingungen und den korrekten Herkunftsbezeichnungen weitergegeben werden. Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. Die systematische Speicherung von Teilen des elektronischen Angebots auf anderen Servern bedarf ebenfalls des schriftlichen Einverständnisses der Rechteinhaber.

Haftungsausschluss

Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr für Vollständigkeit oder Richtigkeit. Es wird keine Haftung übernommen für Schäden durch die Verwendung von Informationen aus diesem Online-Angebot oder durch das Fehlen von Informationen. Dies gilt auch für Inhalte Dritter, die über dieses Angebot zugänglich sind.

Internationale Sommerschule 1996

Dieses Jahr wurde die Internationale Sommerschule der Schweizerischen Aktuarvereinigung vom 22. Juli bis zum 26. Juli in Lausanne abgehalten. Das Thema «Risk Theory» ist so grundlegend wichtig, dass Teilnehmer und Teilnehmerinnen aus vier Kontinenten nach Lausanne angereist waren. Von den 50 Personen, die vorwiegend bei Versicherungsgesellschaften angestellt sind, kam je die Hälfte aus dem Leben-Bereich und dem Nicht-Leben-Bereich.

Am Montag morgen machten wir uns unter der sicheren Leitung von Prof. Hans Gerber mit der Metro auf den Weg zur Universität von Lausanne. Für viele von uns war es eine Erinnerung an lange vergangene Zeiten: Wieder einmal die Bestuhlung in einem Hörsaal viele Stunden am Tag aushalten und in der Mensa essen. Aber welch angenehme Überraschung: Die Sitze im Hörsaal waren ergonomisch geformt und in der Mensa wurde uns – wie allen Studierenden auch – ein Mehrgangmenü serviert. Durch diese sehr angenehme Atmosphäre konnten wir uns gut auf die Vorträge konzentrieren.

Die drei Vortragenden, Prof. Don Jones von der Oregon State University, Prof. François Dufresne von der Université de Lausanne und Prof. Hans Gerber, boten einen pointierten Blick auf das sehr komplexe Thema. Jeder der drei Experten präsentierte seine Sichtweise von ausgewählten Themen der Risikotheorie, so dass mehrere Aspekte berücksichtigt werden konnten. Neben der mathematischen Darstellung kam auch die numerische Umsetzung von Algorithmen nicht zu kurz.

Die einzelnen Vorlesungen orientierten sich an ausgesuchten Kapiteln aus dem Buch «Actuarial Mathematics» von Bowers, Gerber, Hickman, Jones und Nesbitt. Den Beginn machte die Betrachtung von individuellen Risikomodellen, denen die kollektiven Risikomodelle am gleichen Tag gegenübergestellt wurden. Anschliessend wurden verschiedene Methoden vorgestellt, die Prämie für eine Stop-Loss-Deckung zu berechnen.

Am Dienstag befassten wir uns mit der zusammengesetzten Poisson-Verteilung und näherten uns den Ruinwahrscheinlichkeiten. Nach so vieler Tätigkeit nutzten wir den Dienstag abend zur körperlichen Ertüchtigung. Ein ruhig geplanter Spaziergang am See entlang nach St-Sulpice geriet ob des stürmischen Wetters zu einem Kampf gegen die tobende Brandung. Aber selbst diejenigen von uns, die etwas nass geworden waren, wurden durch ein gutes Abendessen mehr als entschädigt.

Der Mittwoch gehörte den Martingalen, die sich als effektive Instrumente in der Risikotheorie erweisen. Am Abend fand der kulturelle Höhepunkte dieser Som-

merschule statt: Nach einer sehr kundigen Führung durch die Kathedrale von Lausanne überraschte uns Prof. Marc-Henri Amsler mit einem professionellen Orgelkonzert und Werken u. a. von Bach und Brahms.

Am Donnerstag lernten wir in einem kurzen mathematischen Abstecher die Preisgestaltung von Optionen in stetiger Zeit kennen. Der mathematische Ansatz mit Poisson-Prozessen bot auch für die Experten interessanten Stoff zur Diskussion. Auch hier zeigten Martingale wieder ihren grossen Nutzen. Insbesondere für die Anwendung im Leben-Bereich wichtig war die Erweiterung der Methode von Kornya, die zusätzlich eine numerisch schnellere Implementation des Algorithmus ermöglicht.

Erneuerungstheoretische Aspekte der Ruinwahrscheinlichkeit waren am Freitag ein Thema, das noch vertieft wurde. Nicht unerwähnt bleiben sollten die Lab Sessions, die jeden Nachmittag stattfanden. Diese boten Gelegenheit, einige von vielen Aufgaben zu rechnen, die der Vertiefung des vorher dargebrachten Stoffes dienten. Lösungen zu einigen dieser Aufgaben wurden anschliessend von den drei Vortragenden selbst dargeboten.

Als Fazit kann festgestellt werden, dass diese Woche in Lausanne einen sehr interessanten Überblick über die mathematische Risikotheorie geboten hat. Darüber hinaus konnten viele Kontakte geknüpft werden zu Aktuaren in anderen Gesellschaften.

Eva Kreuzberger

Internationale Sommerschule 1997

Die 14. Internationale Sommerschule unserer Vereinigung findet vom 21. bis 25. Juli 1997 an der Universität Lausanne statt. Das Thema ist

Asset/Liability Management: From Immunization to the Theory of Option Pricing

Für die wissenschaftliche Leitung konnte Professor Elias Shiu (Universität von Iowa, USA) gewonnen werden. Der Kurs wird wie folgt beschrieben: "A main purpose of this course is to show how life insurers can cope sensibly with the problem of interest rate risk. Topics to be treated will include: arbitrage-free models of the term structure of interest rates, cash flow matching algorithms, immunization theory, market valuation of assets and insurance liabilities in a unified framework, product pricing consistent with capital markets, dynamic hedging."

Anmeldeformulare können bei Herrn Dr. H. Tobler, Sekretär des Präsidenten der SAV, Schweizer Rück, 8022 Zürich, bezogen werden. Der Anmeldetermin ist der 31. März 1997. Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

Hans U. Gerber