Internationale Sommerschule 1994

Autor(en): **Koller, Michael**

Objekttyp: **Article**

Zeitschrift: **Mitteilungen / Schweizerische Vereinigung der Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries**

Band (Jahr): **- (1994)**

Heft 2

PDF erstellt am: **04.06.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-967200

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.

Ein Dienst der *ETH-Bibliothek*
ETH Zürich, Rämistrasse 101, 8092 Zürich, Schweiz, www.library.ethz.ch

http://www.e-periodica.ch

Internationale Sommerschule 1994

Die diesjährige Sommerschule der Schweizerischen Vereinigung der Versicherungsmathematiker fand vom 29. August bis zum 2. September in Lausanne statt. Es wurden 50 Personen aus 16 verschiedenen Ländern eingeladen, verschiedenen Vorlesungen über das Thema «Modelling of Extremal Events in Insurance» zu folgen.

Die erste Referentin war Frau PD Dr. Claudia Klüppelberg. Sie diskutierte im Detail die Problematik der Verteilung von Maxima und Ordnungsstatistiken bei der Modellierung von Extremalschäden.

Danach folgte Herr Prof. Dr. Paul Embrechts, der wissenschaftliche Leiter der Sommerschule. Er befasste sich unter anderem mit den «Insurance Futures Contracts», einer speziellen Art von Rückversicherung, bei welcher eine Partei einen Anteil der Schäden der Gegenpartei gegen Entgelt übernimmt.

Eng mit Futures und der Modellierung von Börsenmärkten verbunden sind die stochastischen Differentialgleichungen: Herr Prof. Thomas Mikosch führte die Teilnehmer in das Reich des Wienermasses und des Itokalküls ein, und zeigte einige Anwendungen auf.

Anschliessend las Herr Dr. Alois Gisler von der Winterthur Versicherung über die Grundzüge der Robust Credibility und zeigte, wie diese Theorie in der Praxis Anwendung findet.

Herr Franco Bassi beendete die Sommerschule mit der Vorstellung von zwei Statistikprogrammen. Dabei wurde offensichtlich, was Software wie S-Plus zu leisten vermag.

Neben den eigentlichen Vorlesungen gab es viel Zeit für wertvolle Diskussionen zwischen den Teilnehmern und Dozenten.

Erwähnenswert ist auch der Ausflug am Mittwochnachmittag: Wir starteten bei der Universität Lausanne und gingen dem See entlang nach St-Sulpice, wo uns Herr Prof. Amsler die Besonderheiten der dortigen mittelalterlichen Kirche erläuterte. Anschliessend fuhren wir mit dem Schiff nach Ouchy, wo uns ein Aperitif offeriert wurde.

Alles in allem konnte jeder von dieser Sommerschule profitieren.

Michael Koller

Internationale Sommerschule 1995

Die 12. Internationale Sommerschule unserer Vereinigung findet vom 29. August bis 2. September 1995 am Monte Verità (bei Ascona) statt. Das Thema ist

Mathematical Finance and Insurance.

Der wissenschaftliche Leiter ist Professor Hans Bühlmann; als Dozent konnte u. a. Professor Darrell Duffie (Stanford University) verpflichtet werden. Die Kurssprache ist Englisch.
Folgendes Programm ist vorgesehen: «Stochastic models for the term structure of interest rates provide a natural basis to develop a life assurance model with fluctuating interest rates. The aim of the course is to give an introduction to the discrete and continuous approaches to stochastic interest rates and to discuss some advanced topics, for example analysis of the default risk». Einschreibeformulare können bei Herrn Dr. H. Tobler (Sekretär des Präsidenten der SVVM, c/o Schweizer Rück, Mythenquai 50/60, CH-8022 Zürich) bezogen werden. Die Teilnehmerzahl ist limitiert; Anmeldetermin ist der 15. April 1995.

Hans U. Gerber