Internationale Sommerschule 2009 in Lausanne

Autor(en): **Ambrus, Marcel / Reichert, Thomas**

Objekttyp: **Article**

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

Band (Jahr): **- (2009)**

Heft 1-2

PDF erstellt am: **27.04.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-554993

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 2009 in Lausanne

Die 22. Internationale Sommerschule vom 10. bis 14. August 2009 in Lausanne hatte als Themengebiet «Monte-Carlo-Methoden und Anwendungen in Finanz- und Versicherungsmodellen». An der von Prof. Dufresne (HEC, Université de Lausanne) einmal mehr hervorragend organisierten Veranstaltung nahmen über 100 Teilnehmer aus verschiedenen Ländern teil.

Die wissenschaftlichen Leiter Hansjörg Albrecher (Université de Lausanne) und Ralf Korn (Universität Kaiserslautern) referierten über die Eigenschaften von Monte-Carlo-Simulationsmethoden und deren Anwendungen in stochastischen Zins- und Aktienpreismodellen sowie aktuariellen Fragestellungen. Die zahlreichen Übungsbeispiele wurden jeweils in der letzten Stunde betrachtet und den Teilnehmern in Form von vorbereiteten Excel-Mappen abgegeben.

Am ersten Tag führte Hansjörg Albrecher das Publikum in die grundlegenden Aspekte der Monte-Carlo-Simulation ein. Methoden zur Erzeugung von (Pseudo-) Zufallszahlen wurden dabei ebenso diskutiert wie eine Vielzahl der in der praktischen Anwendung unerlässlichen varianzreduktionstechniken wie zum Beispiel das «Importance Sampling» und die Verwendung von sogenannten Kontrollvariablen. Der zweite Tag – der Vortragende war Ralf Korn – widmete sich der Monte-Carlo-Simulation von stochastischen Prozessen und Differenzialgleichungen, die in vielen Modellen für Aktienpreise und Zinsen vorkommen. Als Beispiele wurden Algorithmen und Simulationsmodelle für das Pricing von exotischen Optionen und für einige gängige Zinsmodelle gezeigt. Die Simulation von asiatischen Optionen und von Preissensitivitäten wurde am Vormittag des dritten Tages besprochen. Am Nachmittag stand ein Ausflug in die Region von Gruyères auf dem Programm, der mit der interessanten Führung durch das Elektrizitätswerk von Broc begann. Danach konnten die Teilnehmer die benachbarte Schokoladenfabrik von Cailler besichtigen. Der Tag fand nach einem Apéro auf dem Moléson mit prächtiger Aussicht und anschliessendem Raclette-Essen im Restaurant bei der Mittelstation der Luftseilbahn einen würdigen Abschluss. Am vierten Tag wurden von H. Albrecher verschiedene Anwendungen von Monte-Carlo-Methoden für aktuarielle Fragestellungen in der Versicherung vorgestellt, wobei insbesondere auch auf die effiziente Simulation von seltenen Ereignissen und Value-at-Risk-Berechnungen eingegangen wurde. Am letzten Tag stellte R. Korn einige neuere und anspruchsvollere Methoden unter anderem zur Simulation von Sprungprozessen vor. Die Sommerschule wurde mit der Übergabe der Zertifikate durch den Ehrengast Prof. H. Bühlmann beendet.

Die Teilnehmer der Sommerschule konnten nicht nur von der kompetenten und lebendigen Präsentation der interessanten und lehrreichen Themen, sondern auch von den zahlreichen Gelegenheiten, neue Kontakte zu knüpfen und sich mit anderen Kollegen auszutauschen, profitieren.

Marcel Ambrus und Thomas Reichert