

# Internationale Sommerschule 1999

Autor(en): **Kohler, Marie-Thérèse**

Objektyp: **Article**

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

Band (Jahr): - **(1998)**

Heft 2

PDF erstellt am: **20.04.2024**

Persistenter Link: <https://doi.org/10.5169/seals-551127>

## **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.

nerer Gruppe fand sich, die den schönen Weg dem See entlang vom Universitätsgelände nach Port de Pully in gut zwei Stunden bewältigte. Wer es etwas gemüthlicher nehmen wollte, ging von der Talstation der Metro nur noch etwa eine halbe Stunde zu Fuss oder liess sich gar per Bus bis vors Restaurant fahren.

Prof. Christian Hipp von der Universität Karlsruhe sprach am Morgen des dritten und letzten Kongresstages zum Thema «Stochastic Control Theory with Applications to Hedging and Ruin Problems». Stochastische Minimierungsprobleme und ihre Lösungen, die auf Hamilton-Jacobi-Bellmann-Gleichungen führen, wurden am Beispiel einer optimalen Investment-Strategie und der Berechnung von Ruinwahrscheinlichkeiten illustriert.

Mit den Abschiedsworten von D. Dufresne und H. U. Gerber ging der 2. Internationale Kongress «Insurance: Mathematics and Economics» am Mittag des 22. Juli 1998 zu Ende. Ein langanhaltender, warmer Applaus war den Veranstaltern und den vielen Helferinnen und Helfern im Hintergrund gewiss.

In bester Erinnerung wird uns die vorzügliche Organisation und die überdurchschnittlich hohe Qualität der Vorträge bleiben. Wir hoffen sehr, dass der dritte gleichnamige Kongress, welcher von Prof. R. Verrall von der City University in London organisiert wird und vom 19. bis 21. Juli 1999 stattfinden wird, auf ein ebenso positives Echo stossen wird.

*Hansjörg Furrer*

## Internationale Sommerschule 1999

Die 15. Internationale Sommerschule unserer Vereinigung fällt mit der «Ecole d'Eté 1999 du Groupe Consultatif des Associations d'Actuaires des pays des communautés européennes» zusammen. Sie findet vom 9. bis 13. August 1999 an der Universität Lausanne statt. Das Thema ist

### *Modelling Extremal Events for Insurance and Finance*

Der wissenschaftliche Leiter ist Professor Paul Embrechts, als Dozent konnte u. a. Dr. Alexander McNeil verpflichtet werden. Die Kurssprache ist englisch. Folgendes Programm ist vorgesehen: „An overview of extreme value theory

---

(EVT) will be given. The newly introduced methodology is exemplified via S-Plus software programs specially written for this purpose. The EVT results are used to complement existing risk management (RM) techniques in finance and insurance. After giving an overview of current best practice in RM, we discuss the ways in which EVT offers a useful tool to go beyond the existing measures, such as Value-at-Risk (VaR). Various examples based on data from insurance and finance are given. We also discuss the necessary RM methodology underlying an Integrated Risk Management System (the integration standing for underwriting as well as investment risk). The usefulness for finance of classical actuarial tools will be highlighted. Some common caveats based on the use of correlation in finance and insurance will be presented.“

Anmeldeformulare können beim Sekretariat SAV, Schweizer Rück, Postfach, CH-8022 Zürich, bezogen werden. Die Teilnehmerzahl ist limitiert. Anmeldetermin ist der 15. April 1999.

*Marie-Thérèse Kohler*

## 26. Internationaler Kongress der Versicherungsmathematiker vom 7. bis 12. Juni 1998 in Birmingham, UK

### 1. Überblick

Über 900 Versicherungsmathematiker aus mehr als 80 Ländern nahmen am Kongress in Birmingham teil. 268 Autoren haben insgesamt 168 Arbeiten abgeliefert. Die Schwerpunktthemen waren ähnlich wie bei früheren Kongressen gesetzt: Lebensversicherung, Nichtlebensversicherung und Risikotheorie, Pensionen und soziale Sicherheit, Krankheit, Sterblichkeit und Pflege, Investment, Berufsständische Fragen.

Diese Hauptthemen sind von den Autoren unter vielen Aspekten aktuarieller Technik und Arbeitsweise angegangen worden (z. B. Datenanalyse und Modellbildung, Risikoklassifikation, Prämienberechnung, Modellierung von Vermögen und Verbindlichkeiten, Dynamische Solvabilitätsprüfung, etc).