

<b>Zeitschrift:</b>	Mitteilungen / Schweizerische Aktuarvereinigung = Bulletin / Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries
<b>Herausgeber:</b>	Schweizerische Aktuarvereinigung
<b>Band:</b>	- (1998)
<b>Heft:</b>	2
<b>Artikel:</b>	2. Internationaler Kongress über "Insurance : Mathematics and Economics" vom 20. bis 22. Juli 1998 in Lausanne
<b>Autor:</b>	Furrer, Hansjörg
<b>DOI:</b>	<a href="https://doi.org/10.5169/seals-551126">https://doi.org/10.5169/seals-551126</a>

### 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:** 11.02.2026

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

## 2. Internationaler Kongress über «Insurance: Mathematics and Economics» vom 20. bis 22. Juli 1998 in Lausanne

Bei hochsommerlichem Wetter fand an der Universität Lausanne vom 20. bis 22. Juli 1998 der 2. Internationale Kongress «Insurance: Mathematics and Economics» statt. Über 100 Teilnehmer aus 22 Nationen trafen sich, um durch eine Vielzahl von sehr interessanten Vorträgen sowohl zu traditionellen wie auch zu neuen Themen der Versicherungsmathematik ihr Wissen zu erweitern und um Ideen auszutauschen. Die von den Herren Professoren A. Dubey, D. Dufresne und H. U. Gerber vorzüglich organisierte Veranstaltung stiess sowohl bei Akademikern wie auch bei Leuten aus der Privatwirtschaft auf grosses Interesse. Genau diese «Heterogenität» der Teilnehmenden verlieh dem Treffen eine besondere Note; sind es doch gerade solche Anlässe, die sich für beide Seiten als sehr fruchtbar erweisen und zu neuen Ideen und Denkanstössen führen. Ein Blick quer durch die Vortragsthemen zeigt nicht nur, wie vielfältig die Versicherungsmathematik ist, sondern auch, dass sich die Forschung aktiv den neuen Problemen und Herausforderungen annimmt, die sich durch das vermehrte Zusammenspiel von Versicherungs- und Finanzinstituten ergeben.

Prof. Elias Shiu von der University of Iowa fiel die Ehre zu, den Kongress mit seinem Vortrag zum Thema «Insurance and Finance: Deferred Annuities» zu eröffnen. Er zeigte am Beispiel aufgeschobener Leibrenten auf, wie sich die Methoden aus der modernen Finanztheorie auf Versicherungsprodukte anwenden lassen. Mit Ausnahme der morgendlichen Eröffnungsvorträge fanden immer zwei Referate gleichzeitig in verschiedenen Hörsälen statt. Dank der grossen Disziplin der Vortragenden, sich strikt an den Zeitplan zu halten, sahen sich die Chairmen nur sehr selten genötigt, mit ihren gelben oder gar roten Karten auf das Ende der Vortragszeit aufmerksam zu machen! Mit der Vermittlung eines Stückes Schweizer Kultur in Form eines Raclette-Abendessens ging der erste Kongresstag zu Ende. Mit seinem Vortrag zum Thema «Insurance Derivatives: Securitisation and other Recent Developments» eröffnete Prof. Sam Cox von der Georgia State University in Atlanta den zweiten Kongresstag. Er machte sich Gedanken zu den neuesten Entwicklungen zur Verbriefung von Versicherungsrisiken und lieferte Argumente für die Dringlichkeit einer vermehrten Forschungsaktivität in diesem Bereich. Das gemeinsame Abendessen des zweiten Tages fand in Port de Pully statt. Die Befürchtungen der Organisatoren, die hohen Temperaturen schreckten zu viele Leute von einem ausgedehnten Spaziergang ab, trafen nicht zu! Eine klei-

---

nere Gruppe fand sich, die den schönen Weg dem See entlang vom Universitätsgelände nach Port de Pully in gut zwei Stunden bewältigte. Wer es etwas gemütlicher 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