

**Zeitschrift:** Mitteilungen / Schweizerische Aktuarvereinigung = Bulletin / Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries  
**Herausgeber:** Schweizerische Aktuarvereinigung  
**Band:** - (1998)  
**Heft:** 2  
  
**Artikel:** Internationale Sommerschule 1999  
**Autor:** Kohler, Marie-Thérèse  
**DOI:** <https://doi.org/10.5169/seals-551127>

### **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:** 06.02.2026

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

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 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).