

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

Herausgeber: Schweizerische Aktuarvereinigung

Band: - (2009)

Heft: 1-2

Artikel: Internationale Sommerschule 2009 in Lausanne

Autor: Ambrus, Marcel / Reichert, Thomas

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-554993>

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: 25.03.2026

ETH-Bibliothek Zürich, E-Periodica, <https://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