

Zeitschrift: Mitteilungen / Schweizerische Vereinigung der
Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association Suisse des
Actuaires = Bulletin / Swiss Association of Actuaries

Band: - (1989)

Heft: 2

Artikel: Internationale Sommerschule 1989

Autor: Ruchti, René

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967213>

Nutzungsbedingungen

Die ETH-Bibliothek ist die Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. 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. [Siehe Rechtliche Hinweise.](#)

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. [Voir Informations légales.](#)

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. [See Legal notice.](#)

Download PDF: 06.10.2024

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

hörden – kantonale und eidgenössische – und Kontrollstellen zu erwähnen, wobei mit ersteren vorwiegend im Zusammenhang mit der definitiven Registrierung diskutiert werden konnte.

Auch in den Arbeiten der BVG-Kommission zur Revision des BVG sind Kammer-Mitglieder engagiert. Die Kammer umfasst im übrigen nach der Generalversammlung 1989 insgesamt 70 ordentliche Mitglieder und 8 Freimitglieder.

Der Präsident: *Pierre Christe*

Internationale Sommerschule 1989

Die 8. Internationale Sommerschule der Schweizerischen Vereinigung der Versicherungsmathematiker war dieses Jahr dem Thema

Modern Investment Finance and Applications

gewidmet. Die Rekordbeteiligung von 57 Teilnehmern (einschliesslich Dozenten) aus 17 Ländern, die sich im Tagungsort Villars einfanden, zeugt vom weltweiten Bekanntheitsgrad dieser beinahe schon zur Tradition gewordenen Institution.

Nach einer allgemeinen Einführung in das Thema des Kurses wurde in einem ersten Abschnitt moderne Portfolio-Theorie behandelt. Investmentstrategien, Beiträge über Optionen und Futures, Modelle für die Bewertung von Optionen und die Formel von Black-Scholes bildeten die weiteren Schwerpunkte. In der zweiten Hälfte des Nachmittages wurde der Stoff der Vorlesungen jeweils durch Übungen vertieft. Eine Übersicht über praktische Anwendungen rundete den Kurs ab.

Die vier Dozenten, die Herren Professoren Artzner (Strasbourg), Boyle (Waterloo), Müller (Zürich) und Shiu (Winnipeg), verstanden es ausgezeichnet, das aktuelle Thema verständlich darzustellen und dabei insbesondere auch das Wirkungsfeld des «Aktuars der dritten Art» zu skizzieren.

Bei schönstem Spätsommerwetter begaben sich die Kursteilnehmer am späteren Dienstagnachmittag in einem zweieinhalbstündigen Marsch ins höhergelegene Taveyannaz, wo in gemütlicher Alphüttenstimmung und umrahmt von

Alphornklängen ein herzhaftes Fondue eingenommen wurde. Zwei kürzere Exkursionen am Mittwoch und Donnerstag förderten und vertieften die persönlichen Kontakte und wirkten zudem angenehm appetitanregend.

Die diesjährige Sommerschule, die von den Herren Professoren Amsler und Gerber kompetent organisiert wurde, war in jeder Hinsicht ein erfreuliches Ereignis.

René Ruchti

22. ASTIN-Kolloquium 1990

Das nächste internationale ASTIN-Kolloquium wird bekanntlich in der Schweiz stattfinden (Montreux, 9.–13. September 1990). Die Themen sind

- 1) Neue Modelle der Finanzmathematik
- 2) Erfahrungstarifizierung
- 3) Numerische Verfahren
- 4) Speaker's Corner

Wer sich für die Teilnahme interessiert, möge bis Jahresende das provisorische Anmeldeformular ausfüllen und an die folgende Adresse schicken:

ASTIN, c/o «La Suisse» Assurances
Case Postale 1307
1001 Lausanne

Das Formular wurde im Frühling 1989 im Bulletin der AAI publiziert; es kann auch beim Leiter der ASTIN-Gruppe, Herrn PD Dr. A. Dubey (Tel. 01/205 29 06) bezogen werden.