

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

Herausgeber: Schweizerische Vereinigung der Versicherungsmathematiker

Band: - (1994)

Heft: 2

Artikel: Internationale Sommerschule 1994

Autor: Koller, Michael

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967200>

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: 02.02.2025

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

Internationale Sommerschule 1994

Die diesjährige Sommerschule der Schweizerischen Vereinigung der Versicherungsmathematiker fand vom 29. August bis zum 2. September in Lausanne statt. Es wurden 50 Personen aus 16 verschiedenen Ländern eingeladen, verschiedenen Vorlesungen über das Thema «Modelling of Extremal Events in Insurance» zu folgen.

Die erste Referentin war Frau PD Dr. Claudia Klüppelberg. Sie diskutierte im Detail die Problematik der Verteilung von Maxima und Ordnungsstatistiken bei der Modellierung von Extremalschäden.

Danach folgte Herr Prof. Dr. Paul Embrechts, der wissenschaftliche Leiter der Sommerschule. Er befasste sich unter anderem mit den «Insurance Futures Contracts», einer speziellen Art von Rückversicherung, bei welcher eine Partei einen Anteil der Schäden der Gegenpartei gegen Entgelt übernimmt.

Eng mit Futures und der Modellierung von Börsenmärkten verbunden sind die stochastischen Differentialgleichungen: Herr Prof. Thomas Mikosch führte die Teilnehmer in das Reich des Wienermasses und des Itokalküls ein, und zeigte einige Anwendungen auf.

Anschliessend las Herr Dr. Alois Gisler von der Winterthur Versicherung über die Grundzüge der Robust Credibility und zeigte, wie diese Theorie in der Praxis Anwendung findet.

Herr Franco Bassi beendete die Sommerschule mit der Vorstellung von zwei Statistikprogrammen. Dabei wurde offensichtlich, was Software wie S-Plus zu leisten vermag.

Neben den eigentlichen Vorlesungen gab es viel Zeit für wertvolle Diskussionen zwischen den Teilnehmern und Dozenten.

Erwähnenswert ist auch der Ausflug am Mittwochnachmittag: Wir starteten bei der Universität Lausanne und gingen dem See entlang nach St-Sulpice, wo uns Herr Prof. Amsler die Besonderheiten der dortigen mittelalterlichen Kirche erläuterte. Anschliessend fuhren wir mit dem Schiff nach Ouchy, wo uns ein Aperitif offeriert wurde.

Alles in allem konnte jeder von dieser Sommerschule profitieren.

Michael Koller

Internationale Sommerschule 1995

Die 12. Internationale Sommerschule unserer Vereinigung findet vom 29. August bis 2. September 1995 am Monte Verità (bei Ascona) statt. Das Thema ist

Mathematical Finance and Insurance.

Der wissenschaftliche Leiter ist Professor Hans Bühlmann; als Dozent konnte u. a. Professor Darrell Duffie (Stanford University) verpflichtet werden. Die Kursprache ist Englisch.

Folgendes Programm ist vorgesehen: «Stochastic models for the term structure of interest rates provide a natural basis to develop a life assurance model with fluctuating interest rates. The aim of the course is to give an introduction to the discrete and continuous approaches to stochastic interest rates and to discuss some advanced topics, for example analysis of the default risk». Einschreibeformulare können bei Herrn Dr. H. Tobler (Sekretär des Präsidenten der SVVM, c/o Schweizer Rück, Mythenquai 50/60, CH-8022 Zürich) bezogen werden. Die Teilnehmerzahl ist limitiert; Anmeldetermin ist der 15. April 1995.

Hans U. Gerber