

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

Autor(en): **Furrer, Hansjörg**

Objektyp: **Article**

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

Band (Jahr): - **(1998)**

Heft 2

PDF erstellt am: **22.07.2024**

Persistenter Link: <https://doi.org/10.5169/seals-551126>

### **Nutzungsbedingungen**

Die ETH-Bibliothek ist Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Inhalten der Zeitschriften. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern.

Die auf der Plattform e-periodica veröffentlichten Dokumente stehen für nicht-kommerzielle Zwecke in Lehre und Forschung sowie für die private Nutzung frei zur Verfügung. Einzelne Dateien oder Ausdrucke aus diesem Angebot können zusammen mit diesen Nutzungsbedingungen und den korrekten Herkunftsbezeichnungen weitergegeben werden.

Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. Die systematische Speicherung von Teilen des elektronischen Angebots auf anderen Servern bedarf ebenfalls des schriftlichen Einverständnisses der Rechteinhaber.

### **Haftungsausschluss**

Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr für Vollständigkeit oder Richtigkeit. Es wird keine Haftung übernommen für Schäden durch die Verwendung von Informationen aus diesem Online-Angebot oder durch das Fehlen von Informationen. Dies gilt auch für Inhalte Dritter, die über dieses Angebot zugänglich sind.

## 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 neueren 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-

nerer 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