

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

Herausgeber: Schweizerische Aktuarvereinigung

Band: - (2006)

Heft: 2

Artikel: Internationale Sommerschule 2006

Autor: Ambrus, Marcel / Makarov, Timofei

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967368>

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: 30.01.2025

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

Internationale Sommerschule 2006

Die Schweizerische Aktuarsvereinigung veranstaltete vom 10. bis 14. Juli an der Universität Lausanne ihre 19. Internationale Sommerschule. Das diesjährige Thema «*Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools*» der von Prof. Dufresne (HEC, Université de Lausanne) organisierten Schule führte zu einem besonders regen Zuspruch von über 100 Teilnehmern aus 27 Ländern und 5 Kontinenten. Die wissenschaftlichen Leiter, Prof. Alexander McNeil (ETH Zürich), Prof. Rüdiger Frey (Universität Leipzig) und Prof. Paul Embrechts (ETH Zürich), die Autoren des neuen Buches «*Quantitative Risk Management*», gaben dem interessierten Publikum in den fünf abwechslungsreichen Tagen einen Einblick in die grundlegenden Ideen des quantitativen Risikomanagements und der gegenwärtig verwendeten mathematischen Methoden. Das Buch, ein Ordner mit den ausgedruckten Folien und eine Testversion der Software S-Plus dienten als Kursunterlagen. Übungsbeispiele in S-Plus ergänzten und illustrierten die in den Vorlesungen gewonnenen Informationen.

Nach einer kurzen Einführung in die Problematik der Modellierung und Messung von finanziellen Risiken wurden am ersten Tag multivariate Risikofaktormodelle behandelt, die vor allem für die Modellierung von Marktrisiken angewendet werden. Auf das moderne Konzept der Copulas zur Messung und Modellierung von Abhängigkeiten zwischen Risiken wurde anschliessend mit vielen Beispielen ausführlich eingegangen. Der zweite Tag war den Verfahren der Extremwerttheorie gewidmet. Zwei grundsätzliche Modelltypen – traditionelle Modelle für Stichprobenmaxima und modernere Pareto-Modelle – und deren Anwendungsmöglichkeiten wurden eingehend vorgestellt. Ein fundierter Überblick über die durch Basel II motivierten und aus der aktuariellen Praxis stammenden Methoden zur Messung des operationellen Risikos war das Thema des dritten Tages, den ein Ausflug nach Gruyères mit Besuch der mittelalterlichen Burg, einer Schaukäserei und anschliessendem sommerlichem Fondueplausch abrundete. Die beiden letzten Tage waren verschiedenen Modellen für das Kreditrisiko – vom klassischen Modell Mertons bis zu modernen dynamischen Modellen für Kredit-Derivate – gewidmet.

In der hervorragend organisierten fünftägigen Sommerschule konnten die Teilnehmer nicht nur neue Ideen für ihre tägliche Arbeit sammeln, sondern auch neue Kontakte mit Kollegen aus verschiedenen Finanzinstitutionen und Universitäten knüpfen.

Marcel Ambrus und Timofei Makarov