École d'été internationale 1988 en Allemagne

Autor(en): **Dufresne, François**

Objekttyp: **Article**

Zeitschrift: **Mitteilungen / Vereinigung Schweizerischer Versicherungsmathematiker = Bulletin / Association des Actuaires Suisses = Bulletin / Association of Swiss Actuaries**

Band (Jahr): **- (1988)**

Heft 2

PDF erstellt am: **26.05.2024**

Persistenter Link: https://doi.org/10.5169/seals-966998

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.

Ein Dienst der *ETH-Bibliothek*
ETH Zürich, Rämistrasse 101, 8092 Zürich, Schweiz, www.library.ethz.ch

http://www.e-periodica.ch

Ecole d'été internationale 1988 en Allemagne

Le Centre de mathématiques appliquées de l'Ecole polytechnique de Darmstadt et de l'Université Kaiserslautern tenait sa quatrième Ecole d'été internationale du 22 au 26 août à l'hôtel du parc Rhön. Le thème général était la «Théorie du risque et les mathématiques d'assurance»; essentiellement deux sujets étaient abordés: la théorie de la crédibilité et l'estimation des réserves IBNR. Les exposés et les séminaires étaient dirigés par le professeur Marc J. Goovaerts, assisté par T. Bauwelinckx.

Les quarante participants étaient conviés en matinée à des exposés théoriques agrémentés de considérations pratiques. L'après-midi était principalement réservé à l'exposition d'applications pratiques réelles et à l'expérimentation de deux logiciels développés par le professeur Goovaerts et son assistant. Le logiciel CRAC 2.0 est basé sur les modèles les plus généraux de la théorie de la crédibilité, soient le modèle hiérarchique et le modèle semi-linéaire de De Vylder. Cette généralité lui a permis de résoudre divers problèmes réels du domaine de l'assurance. Le logiciel RES 1.0 qui a pour objet les réserves IBNR, consiste en la mise en œuvre de plusieurs méthodes du type «chain-ladder» et de la méthode des moindres carrés de De Vylder.

Deux monographies de la Nationale-Nederlanden N.V. servaient de support pédagogique. La langue de travail était l'anglais. La fin d'après-midi du mercredi a été réservée à une marche dans le parc aux abords de la frontière est-allemande.

Les participants ont semblé satisfaits à tous les niveaux: cette interaction théorie-pratique a été appréciée, l'organisation était adéquate, l'ambiance très bonne, le cadre enchanteur; seule ombre au tableau: des températures pas très estivales...

François Dufresne