

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

Band: - (2008)

Heft: 1-2

Artikel: Internationale Sommerschule 2008 in Lausanne

Autor: Bilger, Claire / Ettwein, Frank / Makarov, Timofei

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-551003>

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: 17.11.2024

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

Internationale Sommerschule 2008 in Lausanne

An der diesjährigen 21. Internationalen Sommerschule vom 7. bis 11. Juli in Lausanne ging es um das Thema «Verallgemeinerte Lineare Modelle sowie deren Erweiterungen und Anwendungen in der aktuariellen Wissenschaft». An der von Prof. Dufresne (HEC, Université de Lausanne) hervorragend organisierten Veranstaltung haben ca. 100 Teilnehmer aus den verschiedensten Ländern teilgenommen. Die wissenschaftlichen Leiter Richard Verrall (CAS Business School), Michel Denuit (Université Catholique de Louvain) und Peter England (EMB – Actuaries & Business Consultants) haben dem interessierten Publikum die grundlegenden Ideen der verallgemeinerten linearen Modelle (GLM) in Theorie und Praxis nähergebracht. Einige Übungsbeispiele wurden den Teilnehmern in Form von vorbereiteten Excel-Mappen zur Verfügung gestellt. Zudem wurden die EMB-Produkte ResQ, Emblem und Igloo kurz vorgestellt.

Der erste Tag war einer Einführung in die GLM gewidmet. Dabei wurde ausgehend von der exponentiellen Familie von Verteilungsfunktionen die grundlegende Theorie der GLM entwickelt und anhand eines Beispiels aus der Nichtleben-Tarifierung die Anwendung in der Praxis gezeigt. Thema des zweiten Tages waren zunächst weitere Anwendungen aus dem Bereich Tarifierung in der Nichtlebenversicherung, bevor es danach hauptsächlich um die stochastische Reservierung und das Verfahren des Bootstrapping ging. Ausführlich wurden das over-dispersed Poisson-Modell sowie das Negativ-Binomialmodell behandelt. Am Vormittag des dritten Tages wurden die Techniken der stochastischen Reservierung weiter vertieft. Der Nachmittag war dann reserviert für einen Ausflug in die Region des Genfersees. Bei schönstem Sommerwetter stand eine Führung durch das Schloss Aigle auf dem Programm, an der unter anderem die traditionelle Weinproduktion auf interessante Weise erklärt wurde. Am anschließenden Apéro konnten sich die Teilnehmer von der Qualität der regionalen Weine überzeugen. Abgerundet wurde der Tag mit einem Fondueessen auf dem Pass Col de la Croix.

Diverse Themen standen am vierten Tag auf dem Programm: Zum einen wurde auf Kalenderjahreffekte und Schadeninflation eingegangen, mit denen man in der Schadenreservierung konfrontiert ist. Zum anderen wurden die Bayessche Reservierung und die Bornhuetter-Ferguson-Methode angesprochen. Am Nachmittag des vierten Tages sowie am letzten Tag ging es um Themen aus der Lebensversicherung sowie um Techniken zur geografischen Glättung von Tarifen. Vorgestellt wurden unter anderem verallgemeinerte additive Modelle (GAM) und deren Anwendung zur Modellierung von Sterbetafeln.

Die Teilnehmer der Sommerschule konnten nicht nur von der interessanten Präsentation der Lerninhalte sowie deren praktischer Umsetzung profitieren, sondern es boten sich ihnen darüber hinaus zahlreiche Gelegenheiten, neue Kontakte zu knüpfen und sich mit anderen Kollegen auszutauschen.

Claire Bilger, Frank Ettwein, Timofei Makarov, Mark Wellmann