

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

Herausgeber: Schweizerische Aktuarvereinigung

Band: - (2003)

Heft: 2

Artikel: Internationale Sommerschule 2003

Autor: Buchwalder, Markus

DOI: <https://doi.org/10.5169/seals-967409>

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 2003

Die 16. Internationale Sommerschule der Schweizerischen Aktuarvereinigung vom 22. bis 26. September 2003 wurde hoch über dem Vierwaldstätter See im Hotel Seeblick in Emmetten durchgeführt. Die 39 Teilnehmer aus 10 Nationen trafen sich bereits am Vorabend zum Begrüssungsapéro und Nachtessen.

«Credibility and Its Applications» war das Thema der diesjährigen, von Professor André Dubey (Ecole des HEC, Lausanne) ausgezeichnet organisierten Sommerschule. Nach 1986 und 1987 war dies die dritte Sommerschule, die sich diesem interessanten Thema widmete. In der Versicherungswirtschaft haben sich Credibility-Methoden längst etabliert. Mit Abstand am meisten wird dabei das klassische Bühlmann-Straub-Modell eingesetzt.

Als wissenschaftliche Leiter konnten mit den Professoren Hans Bühlmann und Alois Gisler (beide ETH Zürich) zwei Wissenschaftler gewonnen werden, die massgeblich an der Entwicklung der Credibility-Theorie beteiligt waren. Als Kursunterlage erhielten die Teilnehmer die Monografie «Credibility». Es handelt sich dabei um einen Vorabdruck des Buches, welches die beiden wissenschaftlichen Leiter demnächst herausgeben werden.

In einem ersten Teil der Vorlesungen wurden unter Zuhilfenahme vieler Beispiele die theoretischen Grundlagen der Credibility-Theorie erarbeitet. Formulierung der Fragestellung im Rahmen der Bayes'schen Statistik, Beispiele von Erfahrungstariierungen, im Speziellen auch das Bonus-Malus-System (Fritz Bichsel), Credibility-Schätzer als lineare Bayes-Schätzer.

Darauf aufbauend wurden im Folgenden das Bühlmann-Straub-Modell, Hierarchische Credibility und Multidimensionale Credibility vorgestellt. Credibility im Zusammenhang mit Regression sowie evolutionäre Credibility-Modelle (Kalman-Filter) waren die weiteren Themen.

In den Übungen, hervorragend vorbereitet und betreut durch die Dres. Anne Sheehy und Mario Wüthrich, konnten am Nachmittag jeweils in zwei Gruppen aufschlussreiche Beispiele besprochen und durchgerechnet werden.

Am Donnerstagnachmittag stand, bei herrlichem Spätsommerwetter, ein Ausflug auf dem Programm. Nach einer kurzen Busfahrt führte uns eine Wanderung auf dem «Weg der Schweiz» von Seelisberg hinunter zur Rütliwiese. Nach dem Lunch fuhren wir per Schiff zur Tellsplatte und besuchten die Tellskapelle. Auf fesselnde Weise erzählte Herr Prof. Bühlmann den Teilnehmern die Sage von Wilhelm Tell

und Landvogt Gessler. Weiter führte uns die Wanderung dem Urner See entlang nach Flüelen. Eine eindrucksvolle Fahrt auf dem Dampfschiff Schiller brachte uns schliesslich nach Beckenried wo wir beim Nachtessen den Tag ausklingen liessen.

Viele Anregungen und Ideen können die Teilnehmer aus diesem Kurs mit nach Hause nehmen! Das zeigte sich insbesondere auch in der lebhaften Schlussdiskussion vom Freitagmorgen. Mit den Abschiedsworten der Professoren André Dubey, Hans Bühlmann und Alois Gisler und der Übergabe der Zertifikate ging diese interessante Sommerschule zu Ende.

Markus Buchwalder