

Internationale Sommerschule 2008 in Lausanne

Autor(en): **Bilger, Claire / Ettwein, Frank / Makarov, Timofei**

Objektyp: **Article**

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

Band (Jahr): - **(2008)**

Heft 1-2

PDF erstellt am: **22.07.2024**

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

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.

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