

SÉMINAIRE QUANTACT

Oscar Alberto Quijano Xacur

Concordia University

Primes d'assurance non-vie basées sur les familles Tweedie de modèles linéaires généralisés

Résumé: On considère le problème d'estimation de la prime pure d'un portefeuille d'assurance non-vie lorsqu'une loi de Poisson composée avec taille de sauts gamma est supposée pour la perte cumulée individuelle. Les modèles linéaires généralisés (GLMs) avec une loi de réponse Tweedie sont analysés comme une méthode pour cette estimation. Cette approche est comparée avec la procédure habituelle dans l'industrie qui consiste à combiner des estimations obtenues séparément pour la fréquence et la sévérité en utilisant des GLMs avec réponse Poisson et gamma respectivement.

Vendredi 11 janvier 2013, 13:00-14:00

PK-5115

Département de mathématiques, UQAM

Calendrier du séminaire: www.math.uqam.ca/~renaudjf/seminaires.html