

SÉMINAIRE DE MATHÉMATIQUES ACTUARIELLES ET FINANCIÈRES

organisé par *Quantact*, le *Laboratoire de mathématiques actuarielles et financières* du CRM

CMT-2106
2425, rue de l'Agriculture, Québec
Pavillon Paul-Comtois, Université Laval
3 Février 2017, 14:00-15:00

Thierry Duchesne
Université Laval

Modèles linéaires généralisés mixtes (GLMM) : discussion d'approches classiques pour l'inférence et de leur utilité potentielle pour des applications d'aujourd'hui

Dès la fin des années 1970 et le début des années 1980, des articles étudiaient certains modèles linéaires généralisés mixtes et les méthodes d'inférence qui leur étaient associées. Mais c'est au cours des années 1990 que ces modèles ont vraiment pris leur essor et qu'ils sont devenus populaires dans plusieurs champs d'application. Dans cet exposé, je vais faire un bref retour sur les premières méthodes d'inférence proposées pour ces modèles et nous verrons que ces méthodes ont encore aujourd'hui un certain potentiel pour rendre ces modèles utiles dans des situations de jeux de données complexes ou de grande dimension. En outre je présenterai une méthode d'estimation en deux étapes ainsi qu'un critère de sélection de modèle qui peut en être déduit. Je discuterai d'applications possibles de ces modèles et méthodes en assurance.

Site web: www.quantact.uqam.ca/pages/seminaires

SEMINAR OF ACTUARIAL AND FINANCIAL MATHEMATICS

organized by *Quantact*, the *CRM Laboratory of Actuarial and Financial Mathematics*

CMT-2106
2425, rue de l'Agriculture, Québec
Pavillon Paul-Comtois, Université Laval
February 3rd 2017, 14:00-16:00