

# **6e atelier des étudiants gradués en mathématiques actuarielles et financières**

Vendredi, 17 mars 2017

## **6e Graduate Student Workshop on Actuarial and Financial Mathematics**

Friday, March 17<sup>th</sup>, 2017

---

UQAM - Pavillon Président-Kennedy Building, PK-1780.

---

### **Programme/Program**

**9:50 - 10:00** - [Mot de bienvenue / Welcoming address](#)

**10:00 - 11:00** - Itre Mtalai, Université Laval, Québec.  
“Hierarchical Archimedian copulas through multivariate  
compound distributions”.

**11:00 - 11:15** - [Pause café / Coffee Break](#)

**11:15 - 12:15** - Lu Cao, Concordia University, Montréal.  
“The Multivariate Extension of a Robust Risk Measure:  
Vector-Valued Range Value-at-Risk”.

**12:15 - 14:00** - [Dîner / Lunch](#)

**14:00 - 15:00** - Maxime Roussakov, Université de Montréal, Montréal.  
“Time Series Prediction using the Self-Organizing Map  
algorithm”.

**15:00- 15:15** - [Pause café / Coffee Break](#)

**15:15 - 16:15** - Hugo Lamarre, HEC, Montréal.

“The economic value of volatility timing for the risk premium in hedged S&P500 options”.

**16:15- 16:30** - [Pause café / Coffee Break](#)

**16:30 - 17:30** - Mohamed Amine Lbakous, UQAM, Montréal

“Étude d'une mesure de risque dérivée de la probabilité de ruine Parisienne cumulative”.

**17:30 -17:40** - [Mot de la fin / Concluding Remarks](#)