

Évaluation de la fonction de pénalité de Gerber et Shiu avec dépendance entre les montants et les temps des sinistres

Fouad Marri (étudiant au doctorat)
Université Laval

7 décembre 2007, 14:00-15:00

Salle/Room PK-5115, Pavillon Président-Kennedy
200, av. Président-Kennedy, UQAM

Résumé/Abstract:

Le but de cet exposé est de présenter une extension du modèle classique de la théorie collective du risque. On considère une structure de dépendance entre les montants et les temps des sinistres via une famille de copule asymétrique. Cette famille de copules englobe la copule de Farlie-Gumbel-Morgenstern généralisée présentée par Lai&Xie (2000). Certains résultats concernant le calcul de la fonction de pénalité de Gerber & Shiu seront présentés. Une étude de l'effet de la dépendance sur la fonction de pénalité conclut cet exposé.

Organisé par : Groupe ISM en mathématiques actuarielles et financières

Organized by: ISM group in Actuarial and Financial Mathematics

www.dms.umontreal.ca/~morales/seminar_main.htm