

MODULE D'APPLICATION – TARIFICATION IARD – RISQUE DE MASSE

1 jour

Fiche d'inscription
sur www.caritat.fr

Assurances dommages



À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et autres collaborateurs des services techniques et bureaux d'études des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, de l'audit et du conseil, et à toute personne désireuse de maîtriser les modèles de tarification en assurance IARD.

Pour obtenir quoi ?

Savoir segmenter son portefeuille en classes de risque adaptées à une tarification IARD. Maîtriser la mise en œuvre des modèles économétriques à des fins de tarification, et connaître les points faibles/forts des différentes techniques abordées.

Comment ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, par des travaux pratiques d'application réalisés sous 'R', logiciel libre qui sera fourni aux participants.

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances générales en statistique.

Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

Qui anime cette formation ?



Xavier MILHAUD
Co-responsable de la voie actuariat de l'ENSAE ParisTech, membre qualifié de l'Institut des Actuaire.

La formation en pratique...

Quand et où ?

21 septembre 2017

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8^e

Combien ça coûte ?

1 220 € HT + TVA 20%, soit 1 464 € TTC.
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

Réduction de 15% en cas d'inscription simultanée à la formation « Modèles de tarification IARD » des 19 et 20 septembre 2017.

Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :

Elysées West Hôtel - 01 85 34 72 00

Précisez que vous venez de la part de Caritat.

<http://elysees.hotusa.com/caritat/>

Qu'allez-vous apprendre ?

Importer une base Excel (ou SAS) dans le logiciel R

Implémenter en R un module de tarification par modèles non-paramétriques de type arbre :

- Segmenter la population d'assurés
- Travailler sur des données continues et obtenir un tarif par segment
- Le cas des données discrètes

Implémenter en R un modèle de tarification paramétrique de type GLM

- Préparer les données pour les mettre au bon format
- Proposer une modélisation par approche globale (sans distinction fréquence-coût)
- Proposer une modélisation en adoptant une approche fréquence-coût :
 - Modélisation du nombre de sinistres (Cas classique, Surdispersion des données, Modèles avancés et "unbalanced dataset")
 - Modélisation des coûts de sinistres (Répression Gamma, Répression log-normale, Régression Pareto)
- Construire le tarif global en fonction des segments
- Introduire des techniques statistiques pour améliorer les prévisions

Comparaison des différentes méthodes

- Cohérence entre les résultats
- Éléments de comparaison
- Agrégation d'estimateurs

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.