

MODÈLES ÉCONOMÉTRIQUES EN TARIFICATION (RISQUES I.A.R.D. DE MASSE)

2 jours

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 choisir les variables utiles à la tarification IARD. Connaître en détail les différents modèles économétriques et comparer leurs avantages et inconvénients. Manipuler en pratique les modèles de tarification.

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.

Contact :
01 44 51 04 04

Qui anime cette formation ?

Arthur CHARPENTIER, professeur assistant à l'Université de Rennes, professeur associé à l'École Polytechnique, docteur en mathématiques (KUL), membre agrégé de l'Institut des Actuaires.



La formation en pratique...

Quand et où ?

6 et 7 avril 2010

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30
Lieu à préciser (Paris centre)

Combien ça coûte ?

1 950 € HT + TVA 19,60%, soit 2 332,20 € TTC.
Les frais de participation couvrent les deux journées de formation, la documentation complète, les deux déjeuners et les pauses café.

Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :
Elysées West Hôtel - 01 47 75 92 90 - www.ewh.com.
Demandez le tarif Caritat.

Qu'allez-vous apprendre ?



Introduction

Choisir les variables utiles à la tarification des risques IARD

- Les variables qualitatives
- La régression par arbre
- Les variables continues
- Découpages par classes (optimales)
- Analyse discriminante

Modéliser les nombres de sinistres IARD

- Prendre en compte l'exposition (offset)
- La régression de Poisson
- Le modèle ODP Poisson surdispersé
- Le modèle "zero-inflated"

Modéliser les coûts de sinistres

- La régression Gamma
- La régression logNormale

Modéliser les charges annuelles

- Le modèle Poisson composé
- Les modèles Tweedie

Modèles de crédibilité appliqués à la tarification IARD

- Crédibilité au sens de Bühlmann
- Crédibilité versus GLM

Introduction aux modèles dynamiques

- Bonus-malus
- Données de panels

Extension aux modèles de scoring

- Population d'apprentissage, population test
- Régression logistique
- Les courbes ROC

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

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue 2010.