



Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période

Etienne Marceau

↓ Télécharger

📖 Lire En Ligne

Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période Etienne Marceau

Ce livre est le premier de trois volumes consacrés à la modélisation des risques en actuariat. Il fournit les outils statistiques traditionnels développés dans le cadre de la théorie du risque (actuariel traditionnel), mais aussi des techniques de calcul plus spécifiques qui peuvent être appliqués dans le cadre de la gestion des risques pour les institutions financières (Quantative Risk Management) ou les entreprises en général (Entreprise Risk Management). Parmi les applications possibles, on trouvera notamment : l'évaluation des coûts d'un contrat d'assurance général ou de réassurance, le calcul des risques liés à la gestion d'un portefeuille d'obligations ou de devises, la gestion des risques en régimes de retraite, etc. .

↓ [Telecharger Modélisation et évaluation des risques en actuariat : ...pdf](#)

📖 [Lire en Ligne Modélisation et évaluation des risques en actuariat ...pdf](#)

Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période

Etienne Marceau

Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période Etienne Marceau

Ce livre est le premier de trois volumes consacrés à la modélisation des risques en actuariat. Il fournit les outils statistiques traditionnels développés dans le cadre de la théorie du risque (actuariel traditionnel), mais aussi des techniques de calcul plus spécifiques qui peuvent être appliqués dans le cadre de la gestion des risques pour les institutions financières (Quantative Risk Management) ou les entreprises en général (Entreprise Risk Management). Parmi les applications possibles, on trouvera notamment : l'évaluation des coûts d'un contrat d'assurance général ou de réassurance, le calcul des risques liés à la gestion d'un portefeuille d'obligations ou de devises, la gestion des risques en régimes de retraite, etc. .

Téléchargez et lisez en ligne Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période Etienne Marceau

471 pages

Présentation de l'éditeur

Ce livre est consacré à la modélisation et à l'évaluation quantitative des risques en actuariat sur une période. Après un bref rappel des notions en théorie des probabilités, l'auteur présente les modèles de base en actuariat permettant de décrire le comportement des risques en assurance. La mutualisation et les méthodes d'agrégation de risques indépendants sont passées en revue tout comme les notions de base de simulation stochastique et les applications pour l'évaluation quantitative des risques. Une brève introduction aux ordres stochastiques univariés, utilisés pour comparer et expliquer qualitativement le comportement des coûts d'un risque ou d'un portefeuille de risques complète utilement cette première partie. Deux chapitres sont consacrés à la modélisation de la dépendance, offrant une revue des résultats récents portant sur les lois multivariées, les lois composées multivariées, les copules, les méthodes d'agrégation de risques dépendants et l'analyse de l'impact de la dépendance. Dans le dernier chapitre enfin, les auteurs présentent une introduction aux règles d'allocation de capital qui servent à déterminer la part allouée à chaque risque du portefeuille. En raison de l'évolution récente de la science actuarielle, les outils développés dans ce livre peuvent également être appliqués dans le cadre de la gestion des risques pour les institutions financières (Quantitative Risk Management) ou les entreprises en général (Entreprise Risk Management). Un soin particulier a été apporté à la mise en pratique des notions traitées dans cet ouvrage, par le biais d'exemples et d'exercices dont les résultats sont obtenus à l'aide d'un outil informatique. L'ouvrage est destiné à une large audience (étudiants, professionnels et académiques) et seule une connaissance de base en probabilités est requise. Son contenu a été enseigné et testé auprès de plus de mille cinq cents étudiants dans le cadre de cours, allant de la 1^{re} année de License au Master, dispensés à l'École d'actuariat (Université Laval, Québec, Canada), l'Institut des sciences financières et actuarielles (Université Claude-Bernard, Lyon, France), l'Institut des sciences actuarielles (UCL, Louvain-la-Neuve, Belgique) et l'Institut national de statistique et d'économie appliquée (INSEA, Rabat, Maroc). Biographie de l'auteur

Etienne Marceau est professeur titulaire à l'école d'actuariat de l'Université Laval (Québec, Canada). Il est aussi professeur invité à l'Institut de sciences financières et d'assurances (ISFA) de l'Université Lyon 1, poste qu'il a également occupé à l'Université catholique de Louvain (Louvain-la-Neuve, Belgique) et de l'INSEA (Rabat, Maroc). Ses centres d'intérêts dans le domaine de l'enseignement et de la recherche portent notamment sur la modélisation des risques en actuariat la modélisation de la dépendance, la théorie de la ruine, la mortalité stochastique et la gestion actif-passif en actuariat.

Download and Read Online Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période Etienne Marceau #FWP4UV8EMBA

Lire Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau pour ebook en ligne Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau Téléchargement gratuit de PDF, livres audio, livres à lire, bons livres à lire, livres bon marché, bons livres, livres en ligne, livres en ligne, revues de livres epub, lecture de livres en ligne, livres à lire en ligne, bibliothèque en ligne, bons livres à lire, PDF Les meilleurs livres à lire, les meilleurs livres pour lire les livres Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau à lire en ligne. Online Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau ebook Téléchargement PDF Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau Doc Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau Mobipocket Modélisation et évaluation des risques en actuariat : Modèles sur une période par Etienne Marceau EPub

FWP4UV8EMBAFWP4UV8EMBAFWP4UV8EMBA