UQÀM

PLAN DE COURS
Crédibilité (ACT3040)
Automne 2007

COORDONNÉES DU CHARGÉ DE COURS

Chargé de cours : Jean-François Paquin
Adresse électronique : paquin.jean_francois@uqam.ca
Disponibilité : sur rendez-vous

HORAIRE ET LOCAL

Cours
Mardi de 9h à 10h30
Jeudi de 9h à 10h30
Local : SH-2560

Séances d'exercices
Mardi de 10h30 à 12h30
Local : SH-2560

OBJECTIFS DU COURS

Ce cours vise à introduire aux principaux concepts de la crédibilité utilisée en actuariat. La matière de ce cours se retrouve dans l'examen C de la SOA.

CONTENU DU COURS

1) Crédibilité classique : crédibilité totale et partielle
2) Notions de dépendance
3) Crédibilité bayesienne discrète et continue
4) Distributions conjuguées : Gamma-Poisson et autres
5) Crédibilité de Bulhmann et de Buhlmann-Straub et liens avec la crédibilité bayesienne
6) Méthodes bayesiennes non paramétriques et semi-paramétriques
7) Crédibilité hiérarchique
8) Autres types d'évaluation
9) Système de Bonus-Malus
10) Soif du Bonus

ÉVALUATION

Il y aura 2 examens de 3 heures, comptant chacun pour 50 % de la note finale. Le premier examen aura lieu le **vendredi 26 octobre 2007 (13h à 16h)** et le second aura lieu le mardi **18 décembre 2007 (13h à 16h)**. Ces examens sont communs avec l'autre groupe.

Les calculatrices acceptées aux examens sont la *BA-35*, la *BA-II Plus*, la *TI-30Xa* ou la *TI-30X II*. Ces calculatrices sont celles acceptées lors des examens de la SOA / CAS.

LIVRES DE RÉFÉRENCE

Foundations of Casualty Actuarial Science (Fourth Edition), 2001, Casualty Actuarial Society, Chapitre 8, "Credibility", par Mahler, H.C. et Dean, C.G., Sections 1 à 5
(disponible gratuitement sur le site de la SOA, Study Note C-21-01 : http://www.soa.org/files/pdf/C-21-01.pdf)

Topics in Credibility Theory, par Dean, C.G.
(disponible gratuitement sur le site de la SOA, Study Note C-24-05 : http://www.soa.org/files/pdf/c-24-05.pdf)