UQÀM

PLAN DE COURS
Crédibilité (ACT3040)
Hiver 2008

COORDONNÉES DU CHARGÉ DE COURS
Chargé de cours : Jean-François Paquin
Adresse électronique : paquin.jean_francois@uqam.ca
Site web : http://www.geocities.com/paquinj78/

COORDONNÉES DU DÉMONSTRATEUR
Chargé de cours : Nassim Redjouani
Adresse électronique : redjouani.nassim@courrier.uqam.ca

HORAIRE ET LOCAL
Cours
Lundi de 14h à 17h
Local : SB-R740

Séances d'exercices
Mercredi de 14h à 16h
Local : SB-R740

OBJECTIFS DU COURS

Ce cours vise à introduire aux principaux concepts de la crédibilité utilisée en actuariat. Une partie de 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) Système de Bonus-Malus
8) 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 **lundi 3 mars 2008** et le second aura lieu le **lundi 21 avril 2008**.

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)