

---

---

# IBNR PROJECT

---

---

AMEDEO ZITO

FOR THE COURS ACT-7003  
TRAVAIL ACTUARIEL PRATIQUE EN ENTREPRISE

PRESENTED TO PROFESSOR

ILIE RADU MITRIC

THE 4<sup>th</sup> OF MAY 2020



FACULTY OF SCIENCE AND ENGINEERING  
ACTUARIAL SCIENCE  
LAVAL UNIVERSITY  
WINTER 2020



# Summary

bla

## Acknowledgement

*À Étienne Marceau, vous avez toute notre gratitude pour nous avoir offert l'opportunité de faire un tel projet et pour nous avoir guidé et conseillé tout au long de celui-ci.*

*Nous aimerions également remercier Ghislain Léveillé pour nous avoir fait part de son expérience en matière d'analyse de fréquence. Finalement, nous tenons à souligner la générosité du CRSNG (Conseil de Recherche en Sciences Naturelles et de Génie) pour avoir subventionné ce projet.*

## Contents

1	Introduction	1
2	Project objective	1
3	Data Analysis	1
4	Model methodologie	1
5	Results	1
6	Conclusion et discussion	1

## List of Figures

## List of Tables

## **1 Introduction**

## **2 Project objective**

bla

## **3 Data Analysis**

bla

## **4 Model methodology**

bla

## **5 Results**

bla

## **6 Conclusion et discussion**

bal bla



## References

- [Albrecher et al., 2017] Albrecher, H., Teugels, J. L., and Beirlant, J. (2017). *Reinsurance: Actuarial and Statistical Aspects*. John Wiley & Sons.
- [Brazauskas and Kleefeld, 2016] Brazauskas, V. and Kleefeld, A. (2016). Modeling severity and measuring tail risk of norwegian fire claims. *North American Actuarial Journal*, 20(1):1–16.
- [Embrechts and Schmidli, 1994] Embrechts, P. and Schmidli, H. (1994). Modelling of extremal events in insurance and finance. *Zeitschrift für Operations Research*, 39(1):1–34.
- [Klugman et al., 2012] Klugman, S., Panjer, H., and Willmot, G. (2012). *Loss Models: From Data to Decisions*. Wiley, fourth edition.