

ACT-7102 Théorie du risque

Hélène Cossette

8 février 2022

1 Agrégation et allocation de capital

- Houda et Aboubacar
- Cossette, Côté, Marceau et Moutanabbir (2013). Multivariate distribution defined with Farlie-Gumbel-Morgenstern copula and mixed Erlang marginals : aggregation and capital allocation.
- Cas bivarié uniquement.
- Deux méthodes d'allocation de capital.
- Rostan, Olivier et Benjamin :
 - Cossette, Mailhot et Marceau(2012).TVaR-based capital allocation for multivariate compound distributions with positive continuous claim amounts.

2 Travail à effectuer

- Lire les deux articles de recherche mentionnés.
- Préparer deux questions ou commentaires sur les articles que vous n'avez pas à présenter.
- Préparer une présentation pour les articles attribués à votre équipe.
 - Durée : 45 minutes (permettant 10 minutes de question/discussion après)
 - À remettre : diapositives de votre présentation (format pdf), démonstration détaillée des résultats (pas nécessairement tout inclus dans une présentation), code R des illustrations numériques présentées.
 - Le détail des démonstrations peut être fait avec LaTeX ou rédigé à la main (et numérisé) de façon toutetfois très claire et propre. Ceci est pour éviter que vous passiez beaucoup de temps sur la transcription de vos résultats au lieu de sur le contenu des articles.
- Structure de la présentation :
 - Page couverture

- Plan de l'exposé
- Introduction : objectif général de l'article, objectifs spécifiques, motivation
- Revue de la littérature
- Résultats et illustrations numériques
- Conclusion : retour sur ce qui a été fait et ouverture