

ANALYSE DES STATISTIQUES DE MORTALITE : TABLES PERIODIQUES ET PROSPECTIVES A L'USAGE DES ASSUREURS ET DES FONDS DE PENSION.

Objectifs

Ce séminaire a pour but de présenter des techniques modernes d'analyse des statistiques de mortalité et de les appliquer aux données INS et CBFA (1^{er} jour). L'implémentation de ces techniques à l'aide du logiciel R sera ensuite largement abordée (2^{ème} jour).

Formateur

Michel Denuit : Mathématicien, Actuaire et Docteur en Sciences, Professeur à l'UCL

Auteur de plus d'une centaine d'articles scientifiques et de sept ouvrages consacrés à la théorie du risque et à la statistique de l'assurance, M. Denuit a participé au groupe de travail « Mortalité » de l'ARAB de même qu'au groupe de travail qui a élaboré les tables de mortalité prospectives du BfP. Il est également intervenu dans les Summer Schools 2005 « Mortality projections and longevity risk in annuities and pension plans » et 2006 « Modelling mortality dynamics for pensions and annuity business » du Groupe Consultatif Actuariel Européen. Il a participé à la rédaction des ouvrages « Construction de Tables de Mortalité Périodiques et Prospectives » (avec Antoine Delwarde, dans la Collection Audit-Actuariat-Assurance, Economica, Paris) et « Modelling Longevity Dynamics for Pensions and Annuity Business » (avec Ermanno Pitacco, Steven Haberman et Annamaria Olivieri, à paraître fin 2007).



Support

Slides en anglais, y compris les codes R des applications présentées lors de la formation, de même qu'un exemplaire de l'ouvrage « Construction de Tables de Mortalité Périodiques et Prospectives ».

Organisation

La formation se déroulera sur deux jours et se donnera en français. Le premier jour est consacré à des exposés méthodologiques, illustrés par des analyses des statistiques belges (population générale et marché de l'assurance). Il est accessible à un public assez large

Le second jour est dédié aux travaux pratiques. Il est destiné à ceux qui désirent acquérir une expertise opérationnelle en analyse de la mortalité. Les participants sont invités à se munir d'un PC portable sur lequel le logiciel R (gratuit) aura été préalablement installé, de même que les librairies nécessaires et les fichiers de données (fournis par email aux participants) pour les travaux pratiques.

Il est possible de participer uniquement au premier jour. Le nombre de participants au second jour est limité afin de garantir un encadrement personnalisé.

Sommaire

- 1^{ère} Partie : Tables de mortalité périodiques
 - Construction
 - Application aux statistiques INS
 - Prise en compte de l'antisélection et application aux statistiques CBFA.

- 2^{ème} Partie : Tables de mortalité prospectives
 - Manipulation
 - Construction : Modèle de Lee-Carter et variantes
 - Tables BfP.

Informations pratiques

Lieu : Hôtel Mercure - Boulevard de Lauzelle 61 à 1348 LOUVAIN LA NEUVE

Date : Vendredis 19 octobre (1^{er} jour) et 26 octobre (2^{ème} jour) 2007 entre 9h00 et 17h30

Langue : Français

Droit d'inscription : 1.950€ HTVA pour les deux journées ou 850€ HTVA si participation uniquement à la première journée. Une réduction de 150€ HTVA sera accordée en cas d'inscription aux deux journées reçue avant le 31 août 2007.

Inscription via le formulaire disponible en téléchargement sur www.reacfin.com.

Renseignements pédagogiques : Michel Denuit michel.denuit@uclouvain.be