

APPLICATION DU MODÈLE DE MERZ-WUTHRICH

Questions

On utilise les données de *Taylor-Ashe* (cf TP 2).

- i) Calculer la provision par la méthode de Chain-Ladder.
- ii) Estimer la provision et la MSEP dans le cadre du modèle de Mack.
- iii) Estimer la distribution de la réserve en utilisant la méthode du Bootstrap pour deux lois différentes : la loi Gamma, et la loi de Poisson surdispersée.
- iv) En utilisant la fonction *glmReserve* de R, estimer la distribution de la provision.
- v) Estimer les quantités d'intérêt dans le cadre du modèle de Merz-Wuthrich. Comparer les résultats.