

$$W(\alpha, x, \xi) \Rightarrow \max$$

Séminaire Mathématique de Béjaïa (LaMOS)

Revue Spécialisée de Mathématiques et Applications


*Actes du Workshop National
Actuariat et Mathématiques
Financières*

Sous la direction du Pr. Djamil Aïssani


Université de Béjaïa
Faculté des Sciences Exactes
Département de Recherche Opérationnelle
LAMOS
Laboratoire de Modélisation et d'Optimisation des Systèmes

Organisent

Workshop



Actuariat et Mathématiques Financières



Samedi 02 Mai 2009

Campus Targua Ouzamour,
Université de Béjaïa.



Publication et Edition

LaMOS Research Unit
University of Béjaïa

<http://www.lamos.org>

Volume 7
Béjaïa 2009

ISSN : 1112-9433

***Séminaire Mathématique de Béjaïa
(LaMOS)***

Revue Spécialisée de Mathématiques et Applications

**Sous la direction de
Pr. Djamil Aïssani**

Revue : *Séminaire Mathématique de Béjaia (LaMOS)*.

Editeurs : Unité de recherche LaMOS (Modélisation et Optimisation des Systèmes).

Adresse : Université de Béjaia, Compus Targa Ouzamour, 06000 (Algérie).

Tel/Fax : (213) 34 81 37 09.

E-mail : lamos_bejaia@hotmail.com

<http://www.lamos.org>

© Publications de l'Unité de recherche LaMOS, 2009.

Tous droits de traduction, de reproduction
et d'adaptation réservés pour tous les pays.

ISSN : 2112 – 9433

La 4^{ème} Semaine de la Recherche Opérationnelle organisée par le **SCOR** (*Club Scientifique de Recherche Opérationnelle*) est consacrée cette année aux **Mathématiques financières**. Les institutions bancaires et les Compagnies d'assurance sont associées à ce projet. C'est dans ce cadre que le Laboratoire de Recherche *LAMOS* et le Département de Recherche Opérationnelle – Faculté des Sciences Exactes organisent ce Workshop spécialisé en "**Actuariat et Mathématiques Financières**".

Présentation

Les mathématiques financières sont une branche des mathématiques appliquées ayant pour but la modélisation, la quantification et la compréhension des phénomènes régissant les marchés financiers. Elles utilisent principalement des outils issus de l'actualisation, de la théorie des probabilités, du calcul stochastique, des statistiques et du calcul différentiel.

En Algérie, des actions de recherche dans ce domaine ont été initiées ces dernières années, principalement à l'USTHB Alger, Biskra, Annaba et Béjaia. Une conférence plénière avait notamment été programmée lors du Colloque International MOAD'2007 (Béjaia, Novembre 2007). L'un des objectifs de ce Workshop est justement de présenter les orientations de recherche en cours, dans notre pays.

Comité d'Organisation

Djamil AÏSSANI (Coordonnateur)

Mohammed Said RADJEF

Abdelhakim NECIR

Smail ADJABI

Mohand Ouamar BIBI

Hachem SLIMANI

Kamel BOUKHETALA

Fazia RAHMOUNE

Riad REMITA

Zina BENOURET

Samir HAMOUDI

Secrétariat Technique : Nassima Daïri et Halima Berri

Programme des conférences

Programme

Matinée

09h00 : Cérémonie d'ouverture de la Semaine R.O.

10h00 : Boukhetala Kamel (USTHB Alger)

Les Mathématiques financières à l'ère des T.I.C. (Technologies de l'Information et des Communications)

10 h 30 mn: Necir Abdelhakim (Biskra)

Statistique non paramétrique pour les mesures de risques actuarielles et Financières

11h10 mn : Pause-Café

11h30 mn : Remita Riad (Annaba)

Etude de quelques modèles de couverture d'options

12h05 mn: Laib Fodil (Cevital), Radjef Mohand Said (Béjaia)

On the mechanism of the futur Market

Après Midi

14h30 mn : Benouaret Zina (Béjaia)

Stabilité forte des modèles de risques

14h50 mn : Brahim Brahimi (Biskra)

Estimating Distorted Risk Measures of Additive Risks

15h10 mn : Tlilane Lydia (Béjaia)

Efficacité Coût Totale pour l'Optimisation du Coût de Production d'une agence bancaire.

15h30 mn : Djamil Aïssani (Béjaia)

Nouvelles classifications de tarification en assurance RC automobile

Poster

Méthodes statistiques pour l'audit interne des banques

16h00 : Table Ronde: L'Actuariat

Les actuaires sont des professionnels qui analysent l'impact financier du risque en estimant les flux futurs associés. Cette table ronde sera animée par Mer Boumahrat Nourredine (ancien Ministre de la Formation Professionnelle et de l'Emploi), en collaboration avec des responsables des secteurs des banques et assurances.

Index des auteurs

Index des auteurs

ADJABI S., 22, 23

AÏSSANI D., 22 , 23, 26

BENOUARET Z., 20

BOUKHETALA K., 11 , 23

BRAHIMI B., 21

CHABANE N., 26

GACI R., 22

KESSACI S., 22

LAIB F., 19

MERAGHNI D., 21

NECIR A., 14, 21

RADJEF M.S., 19

REMITA M.R., 16

TLILANE L., 22

ZIDOUNI S., 26

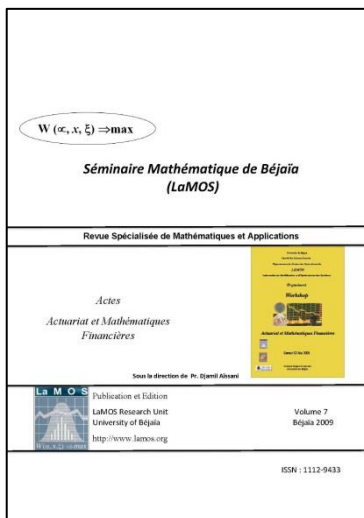
Editions LAMOS 2009

Editions LAMOS 2009

L'ouvrage :

Ce volume regroupe les textes des conférences présentées lors du 1^{er} Workshop national « *Actuariat et Mathématiques Financières* », organisé par le Laboratoire de Recherche LaMOS (en collaboration avec le Club Scientifique de Recherche Opérationnelle SCOR), le samedi 02 mai 2009 à l'auditorium du Campus Targua Ouzamour – Université de Béjaia. Cette manifestation a permis de cerner les orientations de recherche en cours en Algérie. Les actuaires sont des professionnels qui analysent l'impact financier du risque en estimant les flux futurs associés. Un compte rendu de l'Atelier sur l'actuariat a été rédigé par Mr Nourredine Boumahrat (ancien ministre de la formation professionnelle et de l'emploi), en collaboration avec des responsables des secteurs des banques et des assurances.

Séminaire Mathématique de Bejaia (LaMOS). ISSN : 1112 – 9433



Le premier exposé à Bejaia a été présenté en 1987 par Rachid Senoussi (alors enseignant à l'Université de Constantine), à l'époque du projet de création de l'Unité de Recherche en Statistiques Appliquées (1985). Le Séminaire a atteint son rythme de croisière en 1991/1992, après la création du Département des Sciences Exactes (22 exposés programmés). Depuis 1995, il est lié à la Post-Graduation "Modélisation Mathématique et Techniques de Décision" (cf. Bulletin de la S.M.A.I. Société Française de Mathématiques Appliquées et Industrielles N°49, 1997, pp. 50).

Parmi les conférenciers à ce Workshop : Kamel Boukhetala (USTHB Alger), A/Hakim Necir (Biskra), Riad Remita (Annaba), Fodil Laib (Cevital), Nourredine Boumahrat,....

Pour citer ce volume : Revue « *Séminaire Mathématique de Béjaia (LaMOS)* », Volume 7, 2009, 28 pages. ISSN : 1112 – 9433.

ISSN : 1112 – 9433