
ETIENNE MARCEAU, Université Laval

Mesures de ruine pour les modèles de risque basés sur les processus de renouvellement composés avec dépendance

On étudie les mesures de ruine dans les modèles de risque qui supposent la dépendance entre les temps inter-sinistres et les montants des sinistres. On utilise les méthodes de changement de mesure afin d'obtenir des expressions exactes pour la probabilité de ruine et pour la fonction Gerber-Shiu. En se basant sur les expressions de la probabilité de ruine et de la fonction Gerber-Shiu, on développe aussi des inégalités de type Lundberg et des expressions asymptotiques pour ces deux quantités. De plus, on étudie une méthode d'échantillonnage préférentiel basée sur la technique de changement de mesure. Pour les distributions bivariées du couple temps inter-sinistre et montant de sinistre, on développe les lois bivariées correspondantes qui découlent du changement de mesure.