

## Workshop

### Actuariat et Mathématiques Financières

Samedi 02 Mai 2009

Fiche d'inscription

Nom et Prénom : .....

Spécialité : .....

Profession / Grade : .....

Organisme : .....

Adresse : .....

Ville : .....

Tel : ..... Fax : .....

E-Mail : .....

Retourner cette fiche avant le 25 Avril 2009 à l'adresse suivante :

Secrétariat du Workshop sur l'Actuariat et Mathématiques Financières.  
Laboratoire de recherche LAMOS, Université de Béjaïa, Targa  
Ouzamour, 06000 (Algérie).

Tel : (213) 34 21 08 00 Tel/Fax : (213) 34 21 51 88

E-mail : [lamos\\_bejaia@hotmail.com](mailto:lamos_bejaia@hotmail.com)

<http://www.univ-bejaia.dz>

<http://www.lamos.org>

LAMOS

Laboratoire de Modélisation et d'Optimisation des Systèmes

## Workshop



### Actuariat et Mathématiques Financières



Campus Targua Ouzamour, Université de Béjaia

Samedi 02 Mai 2009

La 4<sup>ème</sup> 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 Béjaïa. Une conférence plénière avait notamment été programmée lors du Colloque International MOAD'2007 (Béjaïa, Novembre 2007). L'un des objectifs de ce Workshop est justement de présenter ses orientations de recherche en cours.

## **Comité d'Organisation**

Djamil AÏSSANI (Coordonnateur)  
Mohammed Saïd RADJEF  
Abdelhakim NECIR  
Smail ADJABI  
Mohand Ouamar BIBI  
Hachem SLIMANI  
Kamel BOUKHETALA  
Fazia RAHMOUNE  
Riad REMITA  
Zina BENOURET  
Samir HAMOUDI

## **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 : Laïb Fodil (Cevital), Radjef Mohand Saïd (Béjaïa)

*On the mechanism of the futur Market*

### **Après Midi**

14h30 mn : Benouaret Zina (Béjaïa)

*Stabilité forte des modèles de risques*

14h50 mn : Brahim Brahimi (Biskra)

*Estimating Distorted Risk Measures of Additive Risks*

15h10 mn : Tlilane Lydia (Béjaïa)

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

15h30 mn : Djamil Aïssani (Béjaïa)

*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.