

Datamining en finance

Olivier Lopez - Université Paris VI

Cours : 12 heures - TP : 0 heures

Objectif

- sensibilisation aux problématiques liées au big data en insistant sur les spécificités du secteur de l'assurance;
- donner la capacité de mettre en oeuvre des méthodologies statistiques récentes pour proposer des solutions aux problèmes posés.

Plan

- La souscription du produit d'assurance : Taux de transformation ; "Valeur-client".
- Nouvelles méthodes de tarification : Nouvelles données (objets connectés, internet, données non structurées) ; Evaluation de la qualité des données.
- Anticiper les rachats
- Le provisionnement
- La prévention

Références

- The Elements of Statistical Learning: Data Mining, Inference, and Prediction (Second Edition), by Trevor Hastie, Robert Tibshirani and Jerome Friedman (2009)
- An Introduction to Statistical Learning with Applications in R, by Gareth James, Daniela Witten, Trevor Hastie and Robert Tibshirani (June 2013)