

6e atelier des étudiants gradués en mathématiques actuarielles et financières

Vendredi, 17 mars 2017

6e Graduate Student Workshop on Actuarial and Financial Mathematics

Friday, March 17th, 2017

UQAM - Pavillon Président-Kennedy Building, PK-1780.

Programme/Program

9:50 - 10:00 - [Mot de bienvenue / Welcoming address](#)

10:00 - 11:00 - Itre Mtalai, Université Laval, Québec.
“Hierarchical Archimedian copulas through multivariate compound distributions”.

11:00 - 11:15 - [Pause café / Coffee Break](#)

11:15 - 12:15 - Lu Cao, Concordia University, Montréal.
“The Multivariate Extension of a Robust Risk Measure: Vector-Valued Range Value-at-Risk”.

12:15 - 14:00 - [Dîner / Lunch](#)

14:00 - 15:00 - Maxime Roussakov, Université de Montréal, Montréal.
“Time Series Prediction using the Self-Organizing Map algorithm”.

15:00- 15:15 - [Pause café / Coffee Break](#)

15:15 - 16:15 - Hugo Lamarre, HEC, Montréal.
“The economic value of volatility timing for the risk premium in hedged S&P500 options”.

16:15- 16:30 - [Pause café / Coffee Break](#)

16:30 - 17:30 - Mohamed Amine Lkabous, UQAM, Montréal
“Étude d'une mesure de risque dérivée de la probabilité de ruine Parisienne cumulative”.

17:30 -17:40 - [Mot de la fin / Concluding Remarks](#)