

# Modèles financiers en assurances

**Titulaire**

Pierre DEVOLDER (Coordonnateur)

**Mnémonique du cours**

ACTU-F505

**Crédits ECTS**

5 crédits

**Langue(s) d'enseignement**

Inconnu

**Période du cours**

Deuxième quadrimestre

## Contenu du cours

Tarifification financière en assurance vie ; modèles stochastiques de mortalité ; solvabilité et copules ; théorie du portefeuille

## Objectifs (et/ou acquis d'apprentissages spécifiques)

- > Être capable d'appliquer les techniques de pricing financier à des produits d'assurance vie et à la modélisation de la mortalité - Pouvoir appliquer les techniques de mesures de risque à la solvabilité en assurance en ce compris l'utilisation des copules

## Méthodes d'enseignement et activités d'apprentissages

Cours et projet

## Contribution au profil d'enseignement

Application des techniques de la finance quantitative à divers problèmes d'assurance

## Références, bibliographie et lectures recommandées

Articles en fonction des sujets de l'année

## Méthode(s) d'évaluation

Autre

## Méthode(s) d'évaluation (complément)

Examen oral et projet

## Construction de la note (en ce compris, la pondération des notes partielles)

80% examen oral + 20% projet

## Langue(s) d'évaluation principale(s)

Français

## Programmes

### Programmes proposant ce cours à la faculté des Sciences

MA-ACTU | Master en sciences actuarielles | finalité Spécialisée/  
bloc 2