

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