

5.0 crédits	30.0 h	2q
-------------	--------	----

Enseignants:	Denuit Michel ;
Langue d'enseignement:	Français
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Thèmes abordés :	Familiariser les étudiants avec la théorie des assurances non-vie
Acquis d'apprentissage	<p>Le but de ce cours est de familiariser les étudiants avec les techniques de tarification des produits d'assurance IARD.</p> <p>A l'issue de ce cours, les étudiants devront être capables de modéliser la charge des sinistres et d'établir un schéma de tarification a priori et a posteriori.</p> <p><i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i></p>
Contenu :	<p>Contenu</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Modélisation de l'occurrence des sinistres : la régression logistique 2. Modélisation de la fréquence des sinistres : la régression de Poisson 3. Modélisation du coût des sinistres : la régression gamma 4. Gestion des sinistres graves : la théorie des valeurs extrêmes 5. Théorie de la crédibilité et systèmes bonus-malus 6. Méthodes stochastiques de provisionnement <p>Méthodes</p> <p>Activités en présentiel</p> <p>X0 Exposés magistraux</p> <p>X0 Exercices/TP</p> <p>Activités hors présentiel</p> <p>0 Lectures préparatoires</p> <p>X0 Préparation des exercices</p> <p>X0 Rédaction de travaux</p>
Autres infos :	<p>Evaluation : Examen écrit et participation au cours</p> <p>Support : ex : Transparents fournis via icampus</p> <p>Références : Ce cours est basé sur l'ouvrage Mathématiques de l'Assurance Non-Vie - Tome II (par Michel Denuit & Arthur Charpentier, Economica, Paris)</p>
Cycle et année d'étude: :	<p>> Master [120] en sciences actuarielles</p> <p>> Master [120] en statistiques, orientation générale</p>
Faculté ou entité en charge:	LSBA