

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

Enseignants:	Barbarin Jérôme ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables :	Maîtrise de l'anglais du niveau du cours LANGL1330. Maîtrise des concepts de base de la gestion financière et comptable, du niveau du cours LFSA1290, de macroéconomie, du niveau du cours LECGE1212, de finance stochastique, du niveau des cours LINMA2725 et LACTU2070, ainsi que des outils des mathématiques financières déterministes, du niveau du cours LACTU2020, de Financement des pensions, du niveau du cours LACTU2040, des comptes annuels des entreprises d'assurances, du niveau du cours LACTU2050 et de réassurance, du niveau du cours LACTU2080.
Thèmes abordés :	Principes de la gestion actif passif des compagnies d'assurance, en univers déterministe et stochastique.
Acquis d'apprentissage	<p>Eu égard au référentiel AA (AA du programme de master en sciences actuarielles), cette activité permet aux étudiants de maîtriser</p> <p>--</p> <p>De manière prioritaire les AA suivants :1.1, 1.2, 1.4, 1.8, 2.3, 2.4</p> <p>--</p> <p>De manière secondaire les AA suivants :1.6, 2.1, 2.5, 3.1</p> <p>À l'issue de ce cours, l'étudiant est capable de :</p> <p>--</p> <p>maîtriser les outils nécessaires à la gestion actif-passif d'une société d'assurance</p> <p>--</p> <p>comprendre la dynamique du bilan d'une société financière</p> <p>--</p> <p>mesurer les risques financiers que ce bilan court de manière statique et dynamique</p> <p>--</p> <p>utiliser les différents outils financiers disponibles afin de modifier le profil de risque de l'institution financière ou d'en améliorer la rentabilité</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>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	L'évaluation consiste en la résolution d'une étude de cas.
Méthodes d'enseignement :	Le cours consiste en 14 leçons théoriques illustrées de nombreux exemples.
Contenu :	<p>Les sujets suivants seront développés:</p> <p>--</p> <p>Actifs passifs d'une compagnie d'assurance ainsi que les risques liés à ceux-ci.</p> <p>--</p> <p>Outils de gestion ALM de première génération (analyses statiques déterministes basées sur la durée)</p> <p>--</p> <p>Les actifs hors bilan et leur utilisation dans le cadre de la gestion ALM</p> <p>--</p> <p>Outils d'ALM de seconde génération (stress testing)</p> <p>--</p> <p>Outils de troisième génération (Modélisation stochastique du bilan)</p> <p>--</p> <p>Mesure de performance et mesures de risque (Value at risk et autres)</p> <p>--</p> <p>Capital économique, capital réglementaire (Solvabilité 2)</p>
Bibliographie :	Les transparents sont disponibles via icampus.

<p>Cycle et année d'étude: :</p>	<p><a href="#">&gt; Master [120] en sciences actuarielles</a>  <a href="#">&gt; Master [120] en ingénieur de gestion</a>  <a href="#">&gt; Master [120] en ingénieur de gestion</a></p>
<p>Faculté ou entité en charge:</p>	<p>LSBA</p>