

Au vu du contexte sanitaire lié à la propagation du coronavirus, les modalités d'organisation et d'évaluation des unités d'enseignement ont pu, dans différentes situations, être adaptées ; ces éventuelles nouvelles modalités ont été -ou seront- communiquées par les enseignant-es aux étudiant-es.

5 crédits	30.0 h	Q2
-----------	--------	----

Enseignants	Barbarin Jérôme ;
Langue d'enseignement	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables	<p>Maîtrise de l'anglais du niveau du cours LANGL1330. Maîtrise des concepts au niveau des cours :</p> <ul style="list-style-type: none"> • Mathématiques de l'intérêt et de la finance d'entreprise (LACTU2020) • Finance stochastique (LACTU2170) <p><i>Le(s) prérequis de cette Unité d'enseignement (UE) sont précisés à la fin de cette fiche, en regard des programmes/formations qui proposent cette UE.</i></p>
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> <ul style="list-style-type: none"> • De manière prioritaire les AA suivants :1.1, 1.2, 1.4, 1.8, 2.3, 2.4 • De manière secondaire les AA suivants :1.6, 2.1, 2.5, 3.1 <p>1 À l'issue de ce cours, l'étudiant est capable de :</p> <ul style="list-style-type: none"> • maîtriser les outils nécessaires à la gestion actif-passif d'une société d'assurance • comprendre la dynamique du bilan d'une société financière • mesurer les risques financiers que ce bilan court de manière statique et dynamique • 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> <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	En raison de la crise du COVID-19, les informations de cette rubrique sont particulièrement susceptibles d'être modifiées. L'évaluation consiste en la résolution d'une étude de cas.
Méthodes d'enseignement	En raison de la crise du COVID-19, les informations de cette rubrique sont particulièrement susceptibles d'être modifiées. Le cours consiste en 14 leçons théoriques illustrées de nombreux exemples.
Contenu	<p>Les sujets suivants seront développés:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Actifs passifs d'une compagnie d'assurance ainsi que les risques liés à ceux-ci. • Outils de gestion ALM de première génération (analyses statiques déterministes basées sur la duration) • Les actifs hors bilan et leur utilisation dans le cadre de la gestion ALM • Outils d'ALM de seconde génération (stress testing) • Outils de troisième génération (Modélisation stochastique du bilan) • Mesure de performance et mesures de risque (Value at risk et autres) • Capital économique, capital réglementaire (Solvabilité 2)
Bibliographie	Les transparents fournis renvoient à la littérature spécialisée.

Faculté ou entité en charge:	LSBA
------------------------------	------

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [120] en sciences actuarielles	ACTU2M	5	LACTU2020 ET LACTU2170	