

Faculté des sciences économiques, sociales et politiques



ACTU2122 Compléments d'assurance-vie

[30h] 3 crédits

Enseignant(s): Michel Denuit
Langue d'enseignement : français
Niveau : Second cycle

Objectifs (en termes de compétences)

Ce cours aborde les techniques stochastiques de l'assurance sur la vie. Il complète le cours ACTU 2121 (Assurance-vie I).

Objet de l'activité (principaux thèmes à aborder)

Familiariser les étudiants avec la théorie des opérations viagères sur plusieurs têtes. Etudier en profondeur les bases théoriques de ces opérations, de même que celles des opérations sur une tête.

Résumé : Contenu et Méthodes

- Elaboration de tables de mortalité
- Projections de mortalité
- Techniques de simulation et stress-testing
- Gestion des risques et titrisation

Programmes proposant cette activité

ACTU2MS Master en sciences actuarielles, à finalité spécialisée

Autres crédits de l'activité dans les programmes

ACTU21MS	Première année du master en sciences actuarielles, à finalité spécialisée	(3 crédits)	Obligatoire
----------	---	-------------	-------------