



5.00 crédits	30.0 h	Q1
--------------	--------	----



Cette unité d'enseignement n'est pas accessible aux étudiants d'échange !

Enseignants	Hainaut Donatien ;
Langue d'enseignement	Français
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables	LACTU2030 Actuariat de l'assurance-vie LACTU2170 Valorisation financière des engagements actuariels.
Thèmes abordés	Processus de diffusion avec sauts et de Lévy ou volatilité stochastique. Evaluation des contrats participatifs en présence de taux d'intérêt et mortalité stochastique et couverture.
Acquis d'apprentissage	<p>A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de :</p> <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 : 1.2,1.3,1.6,2.1,2.3,2.4 • De manière secondaire les AA suivants : 1.1,1.5,1.8,3.2 <p>¹ Au terme de ce cours, les étudiants seront capables de</p> <ul style="list-style-type: none"> • Construire un modèle d'actif mixte, diffusion et sauts, Lévy ou avec volatilité stochastique. • Tarifier des options à l'aide de la transformée de Fourier • Valoriser des contrats d'assurance vie lorsque les taux d'intérêt et la mortalité sont stochastiques • Construire une politique d'investissement de couverture.
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 mathématiques	MATH2M	5		
Master [120] en sciences actuarielles	ACTU2M	5		
Master [120] : ingénieur civil en mathématiques appliquées	MAP2M	5		