

3.00 crédits

15.0 h

Q1

Enseignants	Vanbeneden Eddy ;
Langue d'enseignement	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables	Maîtrise de l'anglais du niveau du cours LANGL1330. LACTU2010 Actuariat des assurances dommages LACTU2030 Actuariat de l'assurance-vie LACTU2210 Quantitative Risk Management
Thèmes abordés	Risk taxonomy. Enterprise Risk Management (ERM) process (identification, analysis, measurement and mitigation), with a focus on (re)insurance companies. Interaction among risks. Model risk and governance aspects of risk management. Economic capital model.
Acquis d'apprentissage	A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de : Eu égard au référentiel AA (AA du programme de master en sciences actuarielles), cette activité permet aux étudiants de maîtriser • De manière prioritaire les AA suivants : 1.2, 1.6, 1.7, 2.1 • De manière secondaire les AA suivants : 2.2, 2.4, 3.1, 3.3 Au terme de ce cours, les étudiants seront capables de 1 • Comprendre la démarche et le processus ERM (identification, analyse, mesure et mitigation), en particulier pour les entreprises d'assurance et de réassurance • Comprendre les interactions entre risques • Comprendre les éléments de gouvernance en ERM • Faire les liens entre les différentes techniques actuarielles • Développer un modèle de capital économique simplifié.
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Première session : l'évaluation se fera sur la base d'un examen et d'une étude de cas. Si le nombre d'étudiants le permet, l'examen et la présentation de l'étude de cas seront oraux. Dans le cas contraire, l'examen sera écrit et il n'y aura pas de présentation orale de l'étude de cas. Deuxième session : examen oral. Il n'est pas nécessaire de présenter une étude de cas pour la deuxième session, sauf si l'étudiant n'a pas présenté l'étude de cas pour la première session. Si l'étudiant utilise un outil d'intelligence artificielle pour réaliser l'étude de cas, il est prié d'indiquer quel outil il a utilisé et dans quel but.
Méthodes d'enseignement	Cours ex-cathedra et lectures supplémentaires discutées pendant les cours. Le cours se compose de 7 cours de 2 heures, et d'une session supplémentaire facultative de questions-réponses à la fin du cours.
Bibliographie	• Lam, J. (2000). Enterprise Risk Management, From Incentives to Controls, second edition, Wiley, 2014. • Regulatory texts (Solvency II directive, BNB circulars...) • Practical insurance and reinsurance experience
Autres infos	- Introduction - La gestion des risques en contexte - Gouvernance d'entreprise et gestion des risques - Risques liés au développement durable et ESG - Applications de la gestion des risques - Étude de cas
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	3		