

3.00 crédits

15.0 h

Q2

Enseignants	De Longueville Philippe ;
Langue d'enseignement	Français
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 LACTU2230 Actuariat des assurances de personnes
Thèmes abordés	Marché de la réassurance. Traités de réassurance et leurs caractéristiques. Calcul des primes de réassurance et provisionnement. Réassurance optimale. Méthodes alternatives de transfert de risques.
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 : 1.1, 1.2, 1.3, 1.4, 2.1 • De manière secondaire les AA suivants : 1.6, 1.7, 1.8, 2.3, 2.4, 2.5 A l'issue de ce cours, les étudiants seront capables de : 1 • Comprendre le marché de la réassurance • Comprendre les raisons pour lesquelles une compagnie d'assurance doit être réassurée • Comprendre le fonctionnement de différents types de traités et les clauses principales de ces traités • Réaliser une tarification simple de réassurance en excédent de sinistre • Comprendre les instruments alternatifs de base de réassurance • Comprendre comment la réassurance s'intègre dans Solvabilité 2.
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Première session : l'évaluation sera basée sur un examen et un travail. Si le nombre d'étudiants le permet, l'examen et la présentation du travail seront orales. Autrement l'examen sera écrit et il n'y aura pas de présentation orale du travail. Seconde session : examen oral. Il n'y a pas lieu de réaliser un travail pour la deuxième session sauf si l'étudiant n'a pas remis de travail pour la première session. Si l'étudiant/étudiante utilise un outil d'intelligence artificielle pour la réalisation du travail, celui-ci/celle-ci est prié/priée de mentionner quel outil il/elle a utilisé et à quelle fin.
Méthodes d'enseignement	Cours ex-cathedra accompagné de documents à lire. Le cours consiste en 7 cours de 2 heures. Une session supplémentaire est organisée pour répondre aux questions éventuelles des étudiants. La majorité des supports de cours sont en anglais.
Contenu	• Introduction • Différentes formes de réassurance • Tarification des traités en excédent de sinistres, y compris les clauses particulières principales • Clauses spécifiques aux traités proportionnels • Insurance linked Securities • Introduction du travail • Réassurance et solvabilité 2 • Impact du changement climatique sur les dommages aux biens et aux personnes et importance de la réassurance pour couvrir ces dommages
Bibliographie	• Walhin J.F. (2012). La Réassurance, 2ème édition. Larcier. • Bauwens, V., Walhin, J.F. (2008). La Titrisation du Risque d'Assurance. Larcier. • Walhin, J. F., Herfurth, L., and De Longueville, P. (2001). The practical pricing of excess of loss treaties: actuarial, financial, economic and commercial aspects, Belgian Actuarial Bulletin • Drieskens & all (2010). Stochastic projection for large individual losses, Scandinavian Actuarial Journal • Textes réglementaires (Directive solvabilité 2, circulaires de la BNB...)

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		