Gestion actif-passif d’une société d’assurance

ECTS : 2

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours a pour objectif de faire comprendre pourquoi la gestion actif-passif est particulièrement cruciale au sein d'une société d'assurance et comment elle y est mise en œuvre. Les outils de gestion actif-passif, des premiers jusqu'aux plus récents, font l'objet d'une présentation et d'exercices d'application. Différentes méthodes de couvertures des risques actif-passif seront présentées et analysées à travers des études de cas.

Plan

1. Les enjeux de la gestion actif-passif en assurance : spécificités de l'assurance et différents types de risques.
2. Réglementation et outils en gestion actif-passif.
3. Les simulations actif-passif : modèles déterministes, modèles stochastiques.
4. Les méthodes de couverture des risques de bilan.
5. La gestion financière dédiée.
6. La couverture financière.
7. La réassurance des risques actif-passif.

Compétence à acquérir :

Ce cours a pour objectif de faire comprendre pourquoi la gestion actif-passif des sociétés d’assurance.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen