

## La réassurance

**Langue:** français ou anglais (cours donné en français, certains supports de cours en anglais)

### Objectifs du cours:

- Introduire les étudiants à la réassurance : pourquoi se réassurer, les formes de réassurance.
- Applications actuarielles en réassurance : tarification en excédent de sinistre, réassurance optimale.
- Introduire les étudiants au transfert alternatif de risque.

### Sommaire:

- I. Introduction à la réassurance.
- II. Tarification en réassurance excédent de sinistre : méthode à l'expérience et méthode à l'exposition.
- III. Réassurance optimale.
- IV. Introduction au transfert alternatif du risque (captives, titrisation, ...).
- V. **Retakaful:** la réassurance, basée exclusivement sur le mutualisme. Ainsi, le principe juridique islamique

### Bibliographie:

- La réassurance, Jean-François Walhin (2007), éditions 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, 1, 40-57.
- Lampaert, I. and Walhin, J.F. (2005) On the Optimality of Proportional Reinsurance. Scandinavian Actuarial Journal, 3, 225-239.
- Witdouck, S. and Walhin, J.F. (2004) Some Remarks on the Cedent's Retention Risk in Presence of an Annual Aggregate Deductible or Reinstatements. Blatter Deutsche Gesellschaft für Versicherungsmathematik, 26-3, 461-481.
- M Snoussi, S Desmedt, X Chenut, J F Walhin (à paraître), XL Property Rating: A Reinsurance Pricing Tool Combining Expertise and Exposure Rating for Property Excess of Loss Treaties.
- Autres publications non-scientifiques.

**Méthodologie:** cours en bloc

**Scolarité:** 80 heures (dont 24 heures de présence)

**Mode d'évaluation:** le mode d'évaluation consistera à proposer aux étudiants un examen à la fin du semestre.