

# SÉMINAIRE QUANTACT

**Erika Maldonado**

UQAM

## ÉVALUATION DES RENTES À REVENUS MINIMUMS GARANTIS (GMWB)

**Résumé:** Dans cette présentation, nous introduirons les contrats d'assurance à revenus minimums garantis (GMWB) ainsi que la façon de les évaluer sous différents modèles. Tout d'abord, nous aborderons les différentes façons de voir le contrat. Ensuite, nous trouverons la prime continue devant être payée par l'assuré dans le modèle de Black-Scholes à l'aide de la méthode aux différences finies. Finalement, nous analyserons l'impact de taux d'intérêt stochastiques avec le modèle de Vasicek, ainsi que l'effet de la volatilité stochastique avec le modèle de Heston.

**Mardi 12 novembre 2013, 9:00-12:00**

**PK-1320**

**Département de mathématiques, UQAM**

Calendrier du séminaire: [www.math.uqam.ca/~renaudjf/seminaires.html](http://www.math.uqam.ca/~renaudjf/seminaires.html)