

Emploi 7017 - Section CNU 26

Maître de conférences

MODELISATION MATHEMATIQUE, METHODES NUMERIQUES ET QUANTITATIVES POUR L'ACTUARIAT, LA FINANCE ET LA GESTION DES RISQUES

ENSEIGNEMENT :

La personne recrutée enseignera principalement dans le Master d'actuariat et le Master Econométrie et statistiques. Ses enseignements porteront sur les méthodes numériques et quantitatives utilisées dans les domaines de l'actuariat, de la finance et de la gestion des risques. Elle sera amenée à encadrer des étudiantes et étudiants dans la réalisation de leurs mémoires et à participer au suivi des stages et des alternances dans les filières de formation de l'ISFA. La personne recrutée pourra valoriser son travail d'enseignant-chercheur en développant des relations avec les milieux professionnels concernés (comme par exemple avec l'Institut des Actuaire).

Contact enseignement :

Maud THOMAS, maud.thomas@univ-lyon1.fr

RECHERCHE :

La personne recrutée effectuera ses recherches au sein du Laboratoire de Sciences Actuarielle et Financière (LSAF). Un champ important de la recherche au sein du laboratoire consiste à développer de nouvelles méthodes d'identification des risques financiers et en assurance, de mesure de ces risques aux plans individuel et collectif, d'évaluation des contrats de transferts des risques et de la couverture de ces risques. La personne recrutée développera des activités de recherche autour des méthodes numériques et quantitatives avec des applications en assurance ou en finance. Des travaux portant sur l'utilisation d'algorithmes de type réseaux de neurones pour répondre à des problèmes de contrôle stochastique ou pour construire de nouveaux schémas numériques pour certaines EDP, ou encore sur l'utilisation de l'apprentissage par renforcement ou de modèles génératifs pour des applications en assurance ou en finance, seront très appréciés.

Contact recherche :

Maud THOMAS, Laboratoire du Laboratoire SAF, maud.thomas@univ-lyon1.fr

Informations complémentaires

L'audition des candidats comprendra **une mise en situation professionnelle**

L'organisation de la mise en situation sera indiquée sur la convocation à l'audition.

Emploi 7017 - Section CNU 26

Associate Professor

MATHEMATICAL MODELLING, NUMERICAL AND QUANTITATIVE METHODS FOR ACTUARIAL SCIENCE, FINANCE AND RISK MANAGEMENT

TEACHING :

The person recruited will primarily teach in the Master of Actuarial Science and the Master of Econometrics and Statistics. His/her teaching will focus on numerical and quantitative methods used in the fields of actuarial science, finance, and risk management. He/she will be responsible for supervising students in the completion of their actuarial theses and will participate in monitoring internships and work-study programs in the training courses at ISFA. The person recruited will be able to enhance his/her work by developing relationships with the relevant professional associations (such as with the Institute of Actuaries).

Teaching contact :

Maud THOMAS, maud.thomas@univ-lyon1.fr

RESEARCH :

The person recruited will carry out his/her research within the Actuarial and Financial Sciences Laboratory (LSAF). An important area of research within the laboratory consists of developing new methods for identifying financial and insurance risks, measuring these risks at individual and collective levels, evaluating risk transfer contracts and covering these risks. The person recruited will develop research activities around numerical and quantitative methods with applications in insurance or finance. Works on the use of neural network algorithms to solve stochastic control problems or to construct new numerical schemes for certain PDEs, or on the use of reinforcement learning or generative models for applications in insurance or finance, will be highly appreciated.

Research contact :

Maud THOMAS, head of LSAF, maud.thomas@univ-lyon1.fr

Additional information

Interviews with candidates will include **a simulation of a professional teaching.**

The organisation of this simulation exercise will be indicated on the invitation to the interview.