

Actuariat 2

**ECTS : 4**

**Volume horaire : 39**

**Description du contenu de l'enseignement :**

Volume horaire détaillé :

CM : 19h30

TD : 19h30

1. Introduction au provisionnement en assurance
  1. Provisionnement en assurance non vie : PSAP, méthodes algorithmiques, méthodes stochastiques
  2. Provisionnement en assurance vie : formule prospective et rétrospective
2. Théorie de la crédibilité
  1. Crédibilité bayésienne de Jewell
  2. Crédibilité linéaire de Bühlmann-Straub
3. Théorie de la ruine
  1. Convergence, martingale, formule
  2. Formule explicite Poisson composée
  3. Approximations et borne de Cramer-Lundberg
  4. Impact de la loi de sévérité sur la probabilité de ruine

**Compétence à acquérir :**

Étude de trois problématiques classiques en assurance : la théorie de la ruine (et les processus stochastiques associés), l'introduction au provisionnement vie et non-vie, et la théorie de la crédibilité.

**Mode de contrôle des connaissances :**

1 examen terminal et 1 examen partiel

**Document susceptible de mise à jour - 09/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16**