Actuariat pour le crédit et l’assurance

ECTS : 3

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Initier les étudiants à l’actuariat.

Actuariat des produits de taux simples en univers déterministe.
Obligations, zéro coupon.
Evaluation, courbe de taux, taux futurs, calcul du taux de rendement interne et de la valeur actuelle nette.

Quelques exemples de modèles stochastiques pour aller plus loin.
Principes de l’actuariat en assurance vie et IARD : tables de mortalité et de sinistre, calcul de prime quand les flux sont aléatoires.

Exemples d'implémentation en Python.

Compétence à acquérir :

Connaissance générale en actuariat. Evaluation d'obligations, courbe de taux, calcul de prime en assurance.

Document susceptible de mise à jour - 09/12/2025
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16