

Actuariat 2

ECTS : 6

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 Buhlmann-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 - 06/02/2026

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