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