

Actuariat 2

ECTS : 6

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

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

Enseignant responsable : CHRISTOPHE DUTANG

**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.

**Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026**

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