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 stochastiquesProvisionnement en assurance vie : formule prospective et rétrospective
2. Théorie de la crédibilité Crédibilité bayésienne de JewellCrédibilité 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 - 05/11/2026

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