



SYLLABUS



Niveau d'étude : Master 1
Semestre : 2

ECTS : 3

CM : 30 heures

Cours : **Techniques Actuarielles**

Enseignant : Adrien NGUYEN-HUU

E-mail : adrien.nguyen-huu@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : examen terminal écrit d'1h30

Présentation et objectifs du cours

L'objectif de ce cours est d'introduire, de présenter et de maîtriser les techniques mathématiques du risque en assurance vie et assurance non-vie pour la valorisation, le provisionnement et la gestion des risques. Le cours s'adresse en particulier aux élèves souhaitant continuer en filière Actuariat en Master 2.

Pré-requis

Statistique L3, Economie du risque et de l'incertain L3.

Contenu

Le cours contient :

- des éléments de statistique et de probabilité ;
- des éléments d'économie du risque (espérance, escompte, mesures de risques) ;
- un cours sur les outils de gestion de risque dans le monde financier (produits de taux, swaps) ;
- des éléments de mathématiques des populations.

Éléments bibliographiques

Michel Denuit et Arthur Charpentier. Mathématiques de l'Assurance Non-Vie, tomes 1 et 2. Economica.

www.ressources-actuarielles.net