



SYLLABUS



Cours : Techniques Actuarielles

Ects :

Niveau d'étude : Master 1 MBFA « Parcours Actuariat »

Semestre : 2

CM : 20 heures

Enseignant : Jules SADEFO KAMDEM

TD : 0 heures

E-mail : jules.sadefo-kamdem@umontpellier.fr

Présentation et objectifs du cours

Ce cours a pour objectif est d'apprendre aux étudiants l'utilisation pertinente des outils de mathématiques financières, d'expliquer certaines techniques quantitatives de la finance actuarielle indispensables pour les formations liées aux métiers de l'actuariat.

Pré-requis (Facultatif)

-Éléments de mathématiques

Contenu

- Chapitre 1 : L'intérêt
- Chapitre 2 : Actualisation
- Chapitre 3 : Annuités
- Chapitre 4 : Choix des investissements
- Chapitre 5 : Emprunts Indivis
- Chapitre 6 : Emprunts Obligataires
- Chapitre 7 : Structure par terme de taux d'intérêt
- Chapitre 8 : Produits de Taux d'intérêt
- Chapitre 9 : Duration et immunisation de portefeuille obligataire
- Chapitre 10 : Convexité et Gestion Actif-Passif

Evaluation

Modalité de contrôle des connaissances : **Écrit**

Éléments bibliographiques (Facultatif)

- **Pierre Devolder et Mathide Fox (2018) : Mathématiques Financières, Pearson**