

## Annexe A

Tableau récapitulatif des primes du swap de longévité par cohorte, par maturité et en fonction du prix de marché du risque de longévité.

T	$\pi(60,T)$ $\lambda=25\text{bp}$	$\pi(65,T)$ $\lambda=25\text{bp}$	$\pi(70,T)$ $\lambda=25\text{bp}$	$\pi(60,T)$ $\lambda=50\text{bp}$	$\pi(65,T)$ $\lambda=50\text{bp}$	$\pi(70,T)$ $\lambda=50\text{bp}$	$\pi(60,T)$ $\lambda=75\text{bp}$	$\pi(65,T)$ $\lambda=75\text{bp}$	$\pi(70,T)$ $\lambda=75\text{bp}$
1	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2	0	0	10	0	0	11	0	0	12
3	0	0	20	0	1	23	0	4	27
4	0	0	29	0	3	36	1	8	45
5	0	0	44	0	9	56	4	16	67
6	0	2	60	0	14	78	7	26	97
7	0	5	79	0	22	106	12	38	132
8	0	12	103	2	33	137	16	53	170
9	0	18	129	4	44	173	22	72	215
10	0	27	158	7	60	213	29	94	265
11	0	38	190	12	79	257	38	122	322
12	0	50	229	17	101	308	50	151	386
13	0	66	273	25	126	366	62	186	458
14	0	84	315	34	154	424	78	224	532
15	0	104	357	45	187	483	96	266	606
16	0	129	402	57	223	544	118	315	685
17	0	156	447	73	263	608	140	366	766
18	0	187	496	91	309	676	167	427	853
19	0	218	547	112	355	747	198	487	943
20	10	250	602	135	403	821	230	549	1039
21	24	283	656	160	501	896	268	612	1135
22	41	319	710	190	557	971	308	679	1230
23	62	356	764	223	613	1046	354	750	1325
24	82	395	815	257	672	1118	400	822	1419
25	103	435	863	292	731	1186	448	897	1508
26	126	476	907	330	791	1249	498	975	1591
27	148	517	946	367	850	1307	550	1053	1670
28	173	558	980	408	908	1360	605	1131	1742
29	200	598	1010	450	963	1406	662	1206	1809
30	230	637	1035	495	1015	1446	721	1279	1869

TABLE A.0.1 – Prime du swap de longévité par cohorte, par maturité et en fonction du prix de marché du risque de longévité