Syllabus

Cours: Mathématiques financières I
Sigle: ACT 2025 **Groupe:** 20
Session: Automne 2004

Professeur: Robert Bédard
Bureau: PK-5155
Téléphone: (514) - 987-3000 ext. 3478# (bur.)
Adresse électronique: bedard.robert@uqam.ca

Objectif du cours:
Familiariser l'étudiant avec les principaux concepts des mathématiques financières et lui fournir les outils et techniques nécessaires pour résoudre les problèmes financiers requérant la connaissance des mathématiques financières.

Contenu du cours:
Étude des diverses mesures d'intérêt. Notions de valeurs présentes et accumulées. Rentes certaines. Amortissement progressif et fonds d'amortissement. Taux de rendement. Instruments financiers et leur évaluation. Analyse financière plus avancée.

Évaluation:
Les étudiant(e)s auront à écrire deux examens de trois heures: le premier aura lieu à la septième semaine, le mardi 19 octobre 2004 de 18h00 à 21h00 (le local d'examen sera communiqué en classe après les premières semaines de la session) et portera sur la matière de la première moitié de la session; le second aura lieu à la fin de la session, le mardi 21 décembre 2004 de 18h00 à 21h00 (le local d'examen sera communiqué en classe après les premières semaines de la session) et portera sur la matière de la seconde moitié de la session. Ce sont des examens communs pour tous les groupes du cours ACT2025. Les étudiant(e)s auront aussi à faire deux devoirs. La note finale sera calculée de la façon suivante: si M désigne le résultat sur 100 de l'étudiant(e) à l'examen de mi-session, si F désigne le résultat sur 100 de l'étudiant(e) à l'examen de fin de session et si D désigne le total des résultats des deux devoirs (ce total étant sur 100), alors la note finale pour le cours sera calculée au moyen de la formule

$$0.5 \max\{M, F\} + 0.4 \min\{M, F\} + 0.1D.$$

Manuel:
Des notes de cours sont en vente au secrétariat du département de mathématiques (PK-5151) au prix de 9$. L'horaire de la vente de ces recueils est du mardi 7 septembre au lundi 20 septembre 2004 de 12h00 à 13h00 et de 17h00 à 18h00. Le recueil contient la matière des sept premiers chapitres. Un dernier chapitre est en cours de rédaction. Ce dernier chapitre ainsi que les solutions des exercices contenus dans le recueil de notes de cours seront mis en réserve au comptoir du prêt de la bibliothèque des sciences. Ce recueil est aussi disponible sur internet à l'adresse suivant: `http://www.lacim.uqam.ca/~bedard`

Les livres suivants sont aussi mis en réserve au comptoir du prêt de la bibliothèque des sciences:
Stephen G. Kellison, The Theory of Interest, second edition, Irwin, 1991. Cote:HB539K28 (1991)
Samuel A. Broverman, Mathematics of Investment and Credit, Actex Publications, 1991. Cote:HG4515.3B76
Actex Study Manual for the course 140 examination of the Society of Actuaries. Cote:HG8779A24 (1995) et HG8779A24 (1993)

Horaire des cours et séances d'exercices:
Mardi: 9h00 - 10h30, local: SH-2420 (cours)
Jeudi: 9h00 - 10h30, local: SH-2420 (cours)
Jeudi: 10h30 - 12h30, local: SH-2420 (séances d'exercices)

Heures de consultation:
Mardi: 10h30 - 11h30