ACT 2025 Mathématiques financières 1
Hiver 2009
Professeur : Matthieu Dufour

PK5630, tél. (514) - 987-3000 ext. 7791 Adresse électronique: dufour.matthieu@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 le mercredi 11 mars 2009 de 13h30 à 16h30 (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 mercredi 29 avril 2008 de 13h30 à 16h30 (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. Les étudiant(e)s auront aussi à faire deux devoirs. Le poids de chaque examen est de 45% et celui des devoirs est de 10%.

Manuel:

Le professeur Robert Bédard a rédigé d'excellentes notes de cours. Elles sont en vente à la COOP-UQAM. Le recueil contient la matière des sept premiers chapitres. Ce recueil est aussi disponible sur internet à l'adresse suivante: http://www.lacim.uqam.ca/~bedard. Pour ceux et celles qui désireraient un livre, je suggère celui de James Daniel et Leslie Jane Federer Vaaler, Mathematical Interest Theory. Il est cependant très cher et je vous conseille plutôt de le consulter à la bibliothèque des sciences. Il est en réserve. Vous trouverez sa cote ci-dessous.
Les livres suivants sont aussi mis en réserve au comptoir du prêt de la bibliothèque des sciences:
James W.Daniel et Leslie Jane Federer Vaaler, Mathematical Interest Theory, Pearson Prentice Hall, 2007. Cote: HB 539 D36
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

Calculatrices:

Pour les examens, il vous faudra une calculatrice financière acceptée aux examens de la Society of Actuaries. Vous aurez de toute façon besoin d'une de ces calculatrices pour passer des examens de la SOA et durant vos cours du baccalauréat en actuariat. Voir le site de la SOA à ce sujet : http://tinyurl.com/CalculatricesSOA

Horaire des cours et séances d'exercices:

Mardi: 10h30 - 12h00, local: SB-R440 (cours)
Mercredi: 13h30 - 15h00, local: SB-R440 (cours)
Mercredi: 15h00 - 17h00, local: SB-R440 (séances d'exercices)