Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

PLAN DE COURS
AUTOMNE 2007

ACT 2220 GR: 10 Mathématiques financières II

Professeur : Pierre Caron

Local : SH-R810

Téléphone (bureau) : (514) 393-4899

Téléphone (maison) : (450) 687-7181

Courrier électronique: caron.p@uqam.ca

Les cours seront donnés habituellement le lundi de 13h30 à 15h00 et le mercredi de 13h30 à 15h00. Une séance d'exercice est prévue le mercredi de 15h00 à 17h00. La première séance aura lieu le 19 septembre.

RÉFÉRENCES

«Principes de gestion financière», 8^{e} édition, Richard Brealey, Stewart Myers et Franklin Allen ou la version anglaise de ce livre.

Le cours ACT 2220 couvre les chapitres 1 et 4 à 12 du livre.

OBJECTIFS DU COURS

Note: Ce cours couvre environ la moitié du matériel d'étude de finance corporative exigée par la Society of Actuaries dans le cheminement menant au titre de ASA.

ÉVALUATION PROPOSÉE

Méthodologie d'évaluation proposée :

1 examen durant la session qui compte pour 40% ;

2 travaux qui comptent chacun pour 10% ;

1 examen à la fin de la session qui compte pour 40%.

ACT 2220 GR: 10 Mathématiques financières II

HORAIRE Automne 2007

Chapitre 1 : La finance et le rôle du directeur financier

Chapitre 4 : La valeur des obligations et des actions

Chapitre 5 : Pourquoi la VAN permet-elle d'optimiser les choix d'investissements ?

Chapitre 6 : Choix d'investissement et règle de la valeur actuelle

Chapitre 7 : Rentabilité, risque et coût d'opportunité du capital

Chapitre 8 : Risque et rentabilité

Chapitre 9 : Choix d'investissement et risque

Chapitre 10 : Un projet n'est pas une boîte noire

Chapitre 11 : L'origine des valeurs actuelles nettes positives

Chapitre 12 : Problèmes d'agence, rémunération des dirigeants et mesure de la performance

Calendrier suggéré :

5 septembre	Chapitre 1 et début du Chapitre 4
10 septembre	Chapitre 4 (1|4)
17 septembre	Chapitre 4 (2|4)
19 septembre	Chapitre 4 (3|4)
24 septembre	Chapitre 4 (4|4)
1er octobre	Chapitre 5 (1|2)
3 octobre	Chapitre 5 (2|2)
10 octobre	Chapitre 6 (1|2)
15 octobre	Chapitre 6 (2|2)
17 octobre	Chapitre 7 (1|3)
22 octobre	Chapitre 7 (2|3)
24 octobre	Chapitre 7 (3|3)
29 octobre	Révision pour l'intra
31 octobre	Intra
5 novembre	Chapitre 8 (1|3)
7 novembre	Chapitre 8 (2|3)
12 novembre	Chapitre 8 (3|3)
14 novembre	Chapitre 9 (1|2)

19 novembre	Chapitre 9 (2|2)
21 novembre	Chapitre 10 (1|2)
26 novembre	Chapitre 10 (2|2)
28 novembre	Chapitre 11 (1|3)
3 décembre	Chapitre 11 (2|3)
5 décembre	Chapitre 11 (3|3)
10 décembre	Chapitre 12 (1|2)
12 décembre	Chapitre 12 (2|2)
17 décembre	Révision pour le final
19 décembre	Final

Un premier travail sera remis aux étudiants au plus tard le 5 octobre et il portera sur un sujet couvert dans les 4 premiers chapitres. Le travail devra être complété au plus tard le 9 novembre.

Examen intra le 31 octobre. L'examen d'une durée de 3 heures (de 13h30 à 16h30) portera sur les chapitres 1 et 4 à 7. L'examen comportera principalement des questions à développement.

Un second travail sera remis aux étudiants au plus tard le 16 novembre et il portera sur un sujet couvert dans les chapitres 7, 8 et 9. Le travail devra être remis au plus tard le 21 décembre.

Examen final le 19 décembre. L'examen d'une durée de 3 heures (de 13h30 à 16h30) portera sur l'ensemble de la matière mais l'emphase sera mise sur le contenu des chapitres 7 à 12. L'examen comportera principalement des questions à développement.
