Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

PLAN DE COURS
HIVER 2011

ACT 2320 GR: 30 Mathématiques financières III

Professeur : René Delsanne

Local : PK-5625

Téléphone : 987-3000 poste: 6815

Télécopieur: 987-8935

Courrier électronique: delsanne.rene@uqam.ca

Les cours seront donnés au local SH-2120 habituellement le mercredi de 9h00 à 12h00. Une séance d'exercice est prévue au local SH-2120 le mercredi de 12h00 à 14h00. Certaines semaines, j'enseignerai au cours de la période d'exercice.

RÉFÉRENCES

«Principles of Corporate Finance», 10^{e} édition, Richard Brealey, Stewart Myers et Franklin Allen ou l'édition française du livre, 8^{e} édition publiée sous le titre «Principes de gestion financière»

Le cours ACT 2220 couvre les chapitres 14 à 23 ainsi que le chapitre 29 de la 10^{e} édition ou 13 à 22 ainsi que le chapitre 29 de la 8^{e} édition.

Le livre «Options, Futures, and Other Derivatives», 7^{e} édition, John C. Hull sera également utilisé lors de l'étude des options.

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.

EVALUATION PROPOSEE

Méthodologie d'évaluation proposée :

1 examen à la mi-session qui compte pour 40% ;

1 travail qui compte pour 20% ;

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

ACT 2320 GR: 30 Mathématiques financières III

Date	Heures	Contenu (basé sur la huitième édition)
12 janvier	3	Chapitre 13
19 janvier	3	Chapitre 14
26 janvier	4,5	Chapitre 15 et début chapitre 16
2 février	4,5	Fin du chapitre 16 et chapitre 17
9 février	3	Chapitre 18
16 février	PAS DE COURS	
23 février	1,5	Révision (1,5 heures)
23 février	3	Examen de mi-session (11h00 à 14h00)
2 mars	SEMAINE DE RELÂCHE – PAS DE COURS	
9 mars	3	Chapitre 19
16 mars	3	Chapitre 20
23 mars	3	Chapitre 21
30 mars	3	Chapitre 21
6 avril	3	Chapitre 22
13 avril	3	Chapitre 29
20 avril	3	Révision
27 avril	3	Examen final (9h00 à 12h00)

Le travail sera remis aux étudiants après l'examen intra et portera sur l'évaluation des options. Le travail devra être complété au plus tard le 20 avril. Le travail peut être effectué en équipe de 2 ou 3 étudiants.

L'examen de mi-session du 23 février d'une durée de 3 heures portera sur les chapitres 13 à 18 de la 8e édition. L'examen comportera principalement des questions à développement dont certaines questions théoriques. L'examen final du 27 avril d'une durée de 3 heures portera sur les autres chapitres. L'examen comportera principalement des questions à développement.

Un étudiant qui reprend le cours peut conserver, pour le travail, la note obtenue lors d'une session précédente.