UQÀM
Université du Québec à Montréal

Département de mathématiques

# Plan de cours Automne 2006

## ACT3122 - Actuariat II groupe 30

Cours: SH-3620 - Mercredi de 18h00 à 21h00

### Professeur

Maximilien Boulerice
Courrier électronique: max_boule@yahoo.com

### Objectifs du cours

- Rappel des notions de théorie de l'intérêt présentes sur le curriculum de la SOA
- Préparation à l'examen FM de la SOA
- Introduction aux produits dérivés.

### Évaluation

- Examen intra #1- 30% (27 septembre)
- Examen intra #2- 30% (25 octobre)
- Examen final - 40% (20 décembre)

La calculatrice utilisée lors des examen devra en être une parmi celles acceptées par la SOA
Des points pourront être perdus lors des examens pour une piètre qualité du français.

### Bibliographie

- *Theory of Interest* (2e édition), 1991, Kellison, S.G.,

- Derivatives Markets (2e edition), 2006, McDonald, R.

### Référence

Mathematics of Investment and Credit (3e ed.), 2004, Broverman, S.A.

### Horaire

| Semaine | Chap. Kellison | Semaine | Chap. McDonald |
|---|---|---|---|
| 1 | 1, 2 | 9 | 1 |
| 2 | 3 | 10 | 2 |
| 3 | 4 | 11 | 3 |
| 4 | 5 | 12 | 4 |
| 5 | 6 | 13 | 5 |
| 6 | 7 | 14 | 8 |
| 7 | 8, 9 | 15 | Révision |
| 8 | révision | | |