UQÀM
Université du Québec à Montréal

Département de mathématiques

Plan de cours Automne 2007

ACT3122 - Actuariat II groupe 30

Cours: SH-3420 - Mercredi de 18h00 à 21h00 Démo : Lundi 15h30 à 17h30 au SH-3420

Professeur

Maximilien Boulerice
Courrier électronique: boulerice.maximilien@uqam.ca

Objectifs du cours

- Rappel des notions de mathématiques financières présentes sur le curriculum de la SOA
- Préparation à l'examen FM de la SOA
- Introduction aux produits dérivés et à la gestion de risques.

Évaluation

- Examen intra #1- 25% (10 octobre)
- Examen intra #2- 30% (14 novembre)
- Examen final - 45% (12 décembre)

La calculatrice utilisée lors des examen devra en être une parmi celles acceptées par la SOA

Bibliographie

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

Référence

Mathematics of Investment and Credit (3e ed.), 2004, Broverman, S.A.
Financial Mathematics – A Practical Guide for Actuaries and other Business Professionals (Second Edition), 2005, by C. Ru
Theory of Interest (2e édition), 1991, Kellison, S.G.,

Horaire

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