Plan de cours Automne 2008

ACT3122 - Actuariat II groupe 30

Cours: SH-3620 - Jeudi de 9h00 à 12h00 Démo : Jeudi 12h00 à 14h00 au SH-3620

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
- Introduction aux produits dérivés et à la gestion de risques.
- Préparation à l'examen FM de la SOA

Évaluation

- Examen intra #1- 20% (9 octobre)
- Examen intra #2- 30% (13 novembre)
- Examen final - 50% (11 décembre)

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

Bibliographie

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

Référence

Mathematical Interest Theory, 2007, par J. Daniel et L.Vaaler
Mathematics of Investment and Credit (3e ed.), 2004, Broverman, S.A.
Financial Mathematics : A Practical Guide for Actuaries..., 2005, par C. Ruckman and J. Francis
Theory of Interest (2e édition), 1991, Kellison, S.G.,
ACTEX, BPP, CSM et autres recueils préparatoires (disponibles à la réserve de la bibliothèque)

Horaire

Semaine	**Produits dérivés** Chap. McDonald
1	1,2
2	2,3
3	3,4
4	4,5
5	5,8
6	Examen#1

Semaine	**Mat.fin.** Chap. Daniel et Vaaler
7	1,3
8	4
9	2,5
10	6
11	Examen#2
12	7,8
13	9
14	Révision
15	Examen#3