Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT3122 Actuariat II

Session: Automne 2009
Professeur: Matthieu Dufour
Bureau: PK-5630, (514) 987-3000, poste 7791
Adresse électronique: dufour.matthieu@uqam.ca
Veuillez inscrire "ACT3122" dans l'entête du message lorsque vous m'écrivez.

Objectifs du cours.

Ce cours vise à préparer l'étudiant à l'examen FM de la SOA, et donc à faire en sorte que la passation de cet examen ressemble (un peu) plus à une promenade champêtre par un dimanche après-midi ensoleillé qu'à une extraction de dents de sagesses sans anesthésie. Nous supposerons que tous les concepts ont déjà été vus et nous ne procéderons donc qu'à des rappels rapides suivis d'exercices intensifs.

Contenu du cours

Théorie de l'intérêt
Formules et concepts de base, prêts, annuités ordinaires, croissantes et décroissantes, perpétuités, fonds d'amortissement, calcul du capital résiduel d'un prêt.
Obligations
Rendement interne, duration et convexité, théorie de l'immunisation.
Produits dérivés
Définitions et propriétés des produits dérivés de base, risque de crédit, options de vente et d'achat, colliers, contrats à terme, formule de parité entre options de vente et d'achat.

Évaluation

Il y aura deux examens. Ceux-ci seront du style des examens de la SOA. Aux examens, seules les absences pour raisons médicales avec hospitalisation imprévue seront acceptées. Les simples billets de médecins ne seront donc pas acceptés.

Type d'évaluation	Dates	Heure	Poids
Premier examen	Jeudi 29 octobre	9h00 - 12h00	50%
Deuxième examen	Jeudi 17 décembre	9h00 - 12h00	50%

Horaire des cours

Jeudi	9h00 – 12h00	SH-2420	Cours
Jeudi	12h00 – 14h00	SH-2420	Démonstration

Références

Voir à cet effet le site de la SOA
http://www.soa.org/education/exam-req/edu-exam-fm-detail.aspx