Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT3122 Actuariat II -Automne 2013 **Groupe 10**

Professeur: Ziad Semaan
Adresse électronique: semaan.ziad@uqam.ca

Objectif du cours

Préparer l'étudiant à l'examen FM de la SOA (et examen 2 de la CAS).

Horaire des cours

Lundi	18h00 – 21h00	PK-1350	Cours
Lundi	16h00 – 18h00	PK-1350	Démonstration

Démonstrateur: Jean-François Forest-Désaulniers
Adresse électronique: forest-desaulniers.jean-francois@courrier.uqam.ca

Contenu du cours / Évaluation

Examen intra

- 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

Examen final

- 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

Les examens seront du style des examens de la SOA/CAS.

Type d'évaluation	**Date**	**Heure**	**Poids**
Premier examen - Intra	Lundi 28 octobre	18h00 – 21h00	50%
Deuxième examen - Final	Lundi 16 décembre	18h00 – 21h00	50%

Référence

http://www.beanactuary.org/exams/preliminary/exams/syllabi/2013-08-exam-fm.pdf