# Plan de cours Hiver 2008

# ACT3122 - Actuariat II groupe 20

Cours: SH-3420 - Mardi de 9h00 à 12h00 Démo : Lundi 18h00 à 20h00 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
- Introduction aux produits dérivés et à la gestion de risques.
- Préparation à l'examen FM de la SOA

## Évaluation

- Examen intra #1- 25% ( 12 février )
- Examen intra #2- 30% (18 mars)
- Examen final - 45% (22 avril)

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.,

## Horaire

| Semaine | Chap. Kellison et recueil de notes ACT2025 | Semaine | Chap. McDonald |
|---|---|---|---|
| 1 | 1,2,3 | 8 | Relâche |
| 2 | 4 | 9 | 1,2 |
| 3 | 5,8 | 10 | 2,3 |
| 4 | 6 | 11 | Examen#2 |
| 5 | 7 | 12 | 3,4 |
| 6 | Examen#1 | 13 | 4,5 |
| 7 | 9 | 14 | 5,8 |
| | | 15 | Révision |
| | | 16 | Examen#3 |