Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT3122 Actuariat II - Hiver 2012 **Groupe 40**

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

Objectifs du cours

Ce cours vise à préparer l'étudiant à l'examen FM de la SOA (et examen 2 de la CAS).

Contenu du cours

Théorie de l'intérêt – Examen intra
Formules et concepts de base, prêts, annuités ordinaires, croissantes et décroissantes, perpétuités, fonds d'amortissement, calcul du capital résiduel d'un prêt.

Obligations - Examen intra
Rendement interne, duration et convexité, théorie de l'immunisation.

Produits dérivés – Examen final
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 donc deux examens. Ceux-ci seront du style des examens de la SOA/CAS. 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	Date	Heure	Poids
Premier examen - Intra	Jeudi 8 mars	17h30 – 20h30	50%
Deuxième examen - Final	Jeudi 26 avril	17h30 – 20h30	50%

Horaire des cours

Jeudi	17h30 – 20h30	SH-3620	Cours
Mardi	16h00 – 18h00	SH-3620	Démonstration

Démonstratrice : Sophie Limoges
limoges.sophie.2@courrier.uqam.ca

Références

Voir à cet effet le site
http://www.beanactuary.org/exams/preliminary/exams/syllabi/2012-04-exam-fm.pdf