Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT4020 Mathématiques actuarielles 2

Session: Automne 2017
Professeur: Matthieu Dufour, bur. PK-5630, (514) 987-3000, poste 3210
Adresse électronique: dufour.matthieu@uqam.ca
Veuillez inscrire "ACT4020" dans l'entête du message lorsque vous m'écrivez.

Objectifs du cours.

Ce cours a pour objectif l'étude des modèles actuariels reliés à l'assurance vie. De plus, il prépare l'étudiant pour l'examen «Models for life contingencies» de la SOA.

Contenu du cours

Le cours se décline en quatre grandes parties à peu près indépendantes:
1. Réserves et valeurs de polices
2. Modèles à plusieurs vies
3. Modèles à décréments multiples
4. Processus de Markov et équations de Chapman-Kolmogorov, avec applications à l'actuariat

Évaluation

Il y aura deux examens: un intra et un final. Aux examens, seules les absences pour raisons médicales avec hospitalisation imprévue seront acceptées. Les simples billets de médecins ne seront donc pas acceptés comme justification suffisante d'une absence. Toute tricherie à un examen entraîne automatiquement l'échec au cours.

Type d'évaluation	Dates	Heure	Poids
Premier examen	Jeudi 2 novembre 2017	12h30 -15h30	50%
Deuxième examen	Mardi 19 décembre 2017	10h00 -13h00	50%

Horaire des cours

Mardi	10h00 - 12h00	PK-1620	Exercices
Jeudi	12h30 - 15h30	PK-1620	Cours magistral

Certains cours seront déplacés et repris durant la période d'exercices.

Référence

Models for quantifying risks, 6th Edition, 2013, Camilli, Duncan, London, Actex Madriver editions