Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT4020 Mathématiques actuarielles 2

Session: Hiver 2014
Professeur: Matthieu Dufour, bur. PK-5630, (514) 987-3000, poste 3210
Adresse électronique: dufour.matthieu@uqam.ca
Veuillez inscrire "ACT4121" 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

Réserves, valeurs de polices, risque d'intérêt, modèles à décroissance multiple et à plusieurs vies, processus de Markov., coût émergents, tarification.

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 6 mars 2014	16h00- 19h00	50%
Deuxième examen	Jeudi 24 avril 2014	16h00- 19h00	50%

Horaire des cours

Jeudi	16h00 - 19h00	PK-R610	Cours
Jeudi	19h00 - 21h00	PK-R610	Démo.

Référence

Actuarial Mathematics for Life Contingent Risks, 2nd Edition, 2013, Dickson, D., Hardy, M., Waters, H., Cambridge University Press