0Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT 4121 – MATHÉMATIQUES ACTUARIELLES 3

Automne 2010

Enseignant : Marc Durocher
Courriel : Durocher.Marc@UQAM.ca
MarcDurocher@hotmail.com

Objectif du cours:

L'objectif principal de ce cours est de préparer les étudiants à l'examen C de la SOA.

Un accent particulier sera mis sur une revue des anciens examens de la SOA

Bibliographie

1) Loss Models (Klugman, Panjer, Willmot) - 2e édition (HG8781.K69.2004)
2) ACTEX Study Manual SOA Exam C (Broverman) – 2009

Évaluation :

3 Examens Intras (pondération égale) 100%

Contenu du cours:

Date	Continu	Chapitre (Loss Models)
9 septembre	Variables aléatoires (Révision) Révision Pareto, Gamma	2, 3.1-3.3,
16 septembre	Distributions paramétriques Distributions de queues	4.2, 5.2, 5.3 3.4
23 septembre	Interpolation linéaire Mélange de distributions	4.2.3 5.2.6
30 septembre	Fonctions mixtes continues	5.2
7 octobre	**Examen Intra**	
14 octobre	Limites de police	8.4
21 octobre	Déductibles	8.2
28 octobre	Coassurance Inflation	8.3 8.5
4 novembre	Cas Spéciaux	8.2, 8.5
11 novembre	**Examen Intra**	
18 novembre	Distributions (a,b,0) Distributions Composées	6.1-6.7 9.1-9.6
25 novembre	Convolutions	9.4, 9.6, 9.7, 9.11.2
2 décembre	Mesure de risque VAR, TVAR Stop Loss	3.5 9.3
9 décembre	Simulation	21.1-21.2
16 décembre	**Examen Final**	