Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

ACT4300 Mathématiques de l'assurance de personnes 2

Session: Automne 2020
Professeur: Matthieu Dufour, bur. PK-5630, (514) 987-3000, poste 3210
Adresse électronique: dufour.matthieu@uqam.ca
Veuillez inscrire "ACT4300" dans l'entête du message lorsque vous m'écrivez.

Objectifs du cours.

Ce cours a pour objectif l'étude la deuxième partie des modèles actuariels reliés à l'assurance vie. De plus, il prépare l'étudiant pour l'examen «Long Term Actuarial Risks» de la SOA.

Contenu du cours

Le cours se décline en six parties à peu près indépendantes. Les chapitres réfèrent à la référence:

1. Réserves et valeurs de polices (ch. 7)
2. Modèles à plusieurs vies (ch.10)
3. Mathématiques des régimes de retraite (ch. 11)
4. Modèles à décréments multiples (ch. 9)
5. Modèles à plusieurs états et équations de Chapman-Kolmogorov, avec applications à l'actuariat (ch. 8)
6. Modèles de longévité stochastique (ch. 19)

Évaluation

Il y aura deux examens: un intra et un final. Les examens à distance, selon des modalités qui seront spécifiées au cours de la session. 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	Mardi 27 octobre	13h00 -16h00	50%
Deuxième examen	Mardi 22 décembre	13h00 -16h00	50%

Horaire des cours

Mardi	9h00 - 11h00	Exercices	À être spécifié plus tard
Mardi	13h00 - 16h00	Cours magistral	Zoom: 979 2769 8419

Référence

Actuarial Mathematics for Life Contingent Risks, Third Edition Dickson, C.M.D., Hardy, M.R., Waters, H.R. (2020)

Autres points

Veuillez consulter la «Politique no 16 Politique contre le harcèlement sexuel» de l'UQAM :
https://instances.uqam.ca/wp-content/uploads/sites/47/2018/05/Politique_no_16.pdf

…ainsi que le règlement 18 sur la tricherie et l'intégrité académique

http://r18.uqam.ca/