Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques
ACT4300 Mathématiques de l'assurance de personnes 2

Session: Hiver 2021
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 et limiter vos courriels aux questions cruciales, importantes et essentielles pour le bien-être de l'Humanité….ou presque. Par exemple, je reste aussi longtemps qu'il le faut après chaque cours pour répondre aux questions sur la matière du cours, où il est vingt fois plus efficace de le faire que par courriel.

1. 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.

2. Contenu du cours

Le cours se décline en six parties à peu près indépendantes. Les chapitres réfèrent au livre donné en 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)

3. Évaluation

Il y aura deux examens: un intra et un final. Si le règlement de l'UQAM le permet au moment des examens, ceux-ci auront lieu en présence, à des locaux qui vous seront spécifiés au cours de la session, sinon ils auront lieu en ligne. 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.

Premier examen Jeudi 11 mars14h00 -17h00, 50%
Deuxième examen Jeudi 6 mai 14h00 -17h00, 50%

4. Horaire des cours

Mardi	10h00- 12h00 :	Exercices À être spécifié plus tard
Jeudi	14h00- 17h00 :	Cours magistral Zoom

Lien :
https://uqam.zoom.us/j/83692503251?pwd=L05tNE9XeFlRaW0vSk15RFBlR3VHdz09
Numéro : 836 9250 3251
Code : 647362

5. Référence

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

6. 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/