UniversitéduQuébecàMontréal
Facultédessciences
Départementdemathématiques

ACT-6121:ActuariatIII

Automne2015

(3crédit)

Chargédecours: Jean-FrancoisForest,ASA,AICA,PRM

Coordonnées: Courriel:forest-desaulniers.jean-francois@uqam.ca
Courrielgroupe:153-ACT6121-040@uqam.ca

Horaireducours: Coursthéorique:Jeudi17h30-21h00(Local:PK-R250)

Matérielobligatoire: Aucun.

Logicielutilisé: Aucun.

Descriptionducours

CecoursprépareàlexamenMdelaSocietyofActuariesetàlexamenLCdelaCasualtyActuarial Society.Lesobjectifsdeformationsontatteintsparlarévisiondesconceptsetlasolutiondeproblèmes actuariels.Lessujetssuivantssontcouverts:Assurances-vie,rentes,primesetréserves.Modèlesàvie etdécroissancesmultiples.Modèlesdefréquencesetdecoûtdesaccidents,ChaînesdeMarkov,modèles composésetleursapplications.EnplusdeprépareràlexamenM/3,cecoursprépareàlexamenMFE delaSocietyofActuariesetàlexamen3F/MFEdelaCasualtyActuarialSociety.Lessujetssuivants sontaussicouverts:Arbrebinomiale,ModèledeBlack&Scholes,calculeetinterprétationdeGrecques, théoriedestitreàrevenuefixe,calculstochastiqueentempscontinue,optionsexotiques.

Contenuducours

- **5séancespourlasectionMLC:**
  - Cours1:Rappels,notiondebaseetnotations
  - Cours2:Primes,AssurancesetRentes
  - Cours3:Réservesetmultipledécrément
  - Cours4:ChaînedeMarkov,Assetshare,viemultipleetpension
  - Cours5:Courbedestaux,RisqueN-DetProfit
- **6séancespourlasectionMFE:**
  - Cours1:Conceptsdebaseetarbrebinomial
  - Cours2:ModèledeBlack&Scholes
  - Cours3:Optionsexotiques
  - Cours4:ÉquationsdifférentiellesI
  - Cours5:ÉquationsdifférentiellesII
  - Cours6:TitreàRevenuFixeetSujetsDivers

Évaluation

Descriptiondesévaluations

- Examen:
  - Intra,le17septembre(**50%** delanote)
  - Final,le12novembre(**50%** delanote)

Remarquessupplémentaires

- Lanotefinale(enlettre,A+,A,etc.)pourletrimestreseraattribuéeenfonctiondel'atteinte desobjectifsspécifiquesàtraverslesdeuxévaluations(examenintraetexamenfinal).Ladistribution desrésultatsdanslegroupepourraitaussiêtreutilisée.Aucuneautreopportunité(travail supplémentaire,etc.)d'augmenterlenombredepointsneseraallouée.

Politiquedereprised'examen
Aucunereprised'examennesera permise,àmoinsdeconditionsexceptionnelles.Lareprised'examen n'estpasundroitmaisunprivilège.Dansdetrèsraresoùunerepriseauraétéautoriséeparleprofesseuretparledépartement,l'examenderepriseserabeaucoupplusdifficilequel'originalpourtenir comptedutempsd'étudesupplémentairedisponible,parsoucid'équitépourlesautresétudiants.

Plagiat,fraudeettricherie
L'UQAMarécemmentinstauréunepolitiquede«tolérancezéro»pourlesinfractionslistéesau Règlement#18(article2).Parconséquent,touteinfractiondecetypeseraimmédiatementsanctionnée (article3).Voirletextecitéplusbas.

RESPECTDEL'INTÉGRITÉACADÉMIQUE

Faceàl'importanceetàl'ampleurduphénomènedelatricherieetduplagiatdans lesuniversités,icietàl'étranger,l'UQAMaamorcé,enjanvier2007,unedémarchevisantàpromouvoirlerespectdel'intégritéacadémique.Danscecontexte etinspiréed'unephilosophiede«tolérancezéro»,laCommissiondesétudesde l'UQAMamodifiésonRèglementsurlesinfractionsdenatureacadémique(R. 18)àsaréuniondu2décembre2008.

Endossantcettephilosophiede«tolérancezéro»relativementauxactesdeplagiat,defraudeetdetricherie,laFacultédessciencesdel'UQAMsouhaitesensibiliserses étudiantsàl'importancedurespectdel'intégritéacadémique.Puisqu'en sollicitantsonadmissionàl'UQAM,toutecandidate,toutcandidats'engageà suivrelespolitiquesetrèglementsdel'Université,laFacultésouhaiteinformer sesétudiantsdesdifférentsarticlesdecerèglement,desactesrépréhensibleset dessanctionsapplicables.Unextraitdecesarticlessetrouveci-dessous.LeRèglementcompletetsonapplicationàlaFacultédessciencessontdisponiblesà l'adresseWebsuivante:

http://www.sciences.uqam.ca/decanat/reglements.php

Tousceseffortsvisentàassurerlavaliditédelaformationdispenséeparla Faculté,ainsiqu'untraitementéquitabledetousafindemaintenirlaqualitédeses diplômes.