Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

PLAN DE COURS
AUTOMNE 2006

ACT 6220 GR: 30 Mathématiques financières 4

Professeur : René Delsanne

Local : PK-5625

Téléphone : 987-3000 poste: 6815#

Télécopieur: 987-8935

Courrier électronique: delsanne@math.uqam.ca

Les cours seront donnés au local SH-3140 habituellement le mardi de 9h00 à 10h30 et le mercredi de 9h00 à 10h30. Une séance d'exercice est prévue le mercredi de 10h30 à 12h00. Certaines semaines, 3 heures de cours seront données le mercredi.

RÉFÉRENCES

Options, Futures, and Other Derivatives, 6^{e} édition, John, C. Hull

Le cours couvre les chapitres 1 à 17, 22, 26 et 28 du livre.

OBJECTIFS DU COURS

Note: Ce cours traite les produits dérivés et la gestion du risque. Les contrats à terme, les Forward, Swaps et options seront étudiés avec une perspective de bien comprendre la théorie sous-jacente à la tarification de ces produits et l'application que l'on peut en faire dans la gestion des investissements. Il permet à l'étudiant d'acquérir une bonne compréhension de ces instruments dérivés et de leur utilisation pour les caisses de retraite et les sociétés d'assurance.

EVALUATION PROPOSEE

Méthodologie d'évaluation proposée :

1 examen durant la session qui compte pour 40% ;

1 examen à la fin de la session qui compte pour 40% ;

1 travail de session qui compte pour 20%.

ACT 6220 GR: 30 Mathématiques financières 4

HORAIRE Automne 2006

Mardi	Heures	Chapitres	Mercredi	Heures	Chapitres
05-sept	1,5	1	06-sept	3	2 et 3
12-sept	1,5	4	13-sept	0	Démo
19-sept	0	Démo	20-sept	0	Démo
26-sept	1,5	6	27-sept	3	5
03-oct	0	Démo	04-oct	3	7
10-oct	1,5	8 et 9	11-oct	3	10 et 22
17-oct	1,5	11	18-oct	1,5	12
24-oct	1,5	12	25-oct	3	Examen
31-oct	0	Démo	01-nov	3	13
07-nov	0	Démo	08-nov	3	14 et 15
14-nov	1,5	16	15-nov	3	17
21-nov	0	Démo	22-nov	0	Démo
28-nov	1,5	26	29-nov	3	26 et 28
05-déc	0	Démo	06-déc	0	Démo
12-déc	1,5	28	13-déc	3	Examen
Total:	13,5			31,5	
