Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

PLAN DE COURS
HIVER 2007

ACT 6220 GR: 20 Mathématiques financières 4

Professeur : Donald Couture

Local : s/o

Téléphone : (514) 281-0205 poste 24

Télécopieur: (514) 281-6215

Courrier électronique: dcouture@franklintempleton.ca

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

RÉFÉRENCES

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

Le cours couvre les chapitres 1 à 7, 11 à 15, 18, 19, 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% ;

Problèmes hebdomadaires qui comptent pour 20%.

ACT 6220 GR: 20 Mathématiques financières 4

HORAIRE Hiver 2007

9 janvier	1.5	1	12 janvier	1.5	2
16 janvier	1.5	3	19 janvier	1.5	4
23 janvier	1.5	4	26 janvier	3	5
30 janvier	1.5	6	2 février	1.5	6
6 février	1.5	7	9 février	3	7 & 11
13 février	Démo		16 février	3	12
20 février	Démo		23 février	3	Examen
27 février	Relâche		2 mars	Relâche	
6 mars	Démo		9 mars	3	13 & 14
13 mars	Démo		16 mars	3	15 & 18
20 mars	Démo		23 mars	3	18 & 19
27 mars	Démo		30 mars	3	26 & 26
3 avril	1.5	26	6 avril	Congé	
10 avril	1.5	28	13 avril	Démo	
17 avril	Démo		20 avril	1.5	28
24 avril	1.5	28	27 avril	3	Examen
Total :	12.0			33.0	