Université du Québec à Montréal
Département de mathématiques

PLAN DE COURS
HIVER 2006

MAT 5420 GR: 20 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-3620 habituellement le mardi de 9h00 à 10h30 et le mercredi de 8h30 à 10h00. Une séance d'exercice est prévue le mercredi de 10h00 à 12h00. Certaines semaines, 3 heures de cours seront données le mercredi.

RÉFÉRENCES

Options, Futures, and Other Derivatives, 5^{e} édition, John, C. Hull

Le cours couvre les chapitres 1 à 14 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 50% ;

1 examen à la fin de la session qui compte pour 50%.

ACT 2220 GR: 10 Mathématiques financières II

HORAIRE Hiver 2006

C

Mardi	Heures	Chapitre	Mercredi	Heures	Chapitre
10-janv	1,5	1	11-janv	1,5	2
17-janv	1,5	2	18-janv	1,5	3
24-janv			25-janv	3	3
31-janv	1,5	4	01-févr	1,5	4
07-févr	1,5	5	08-févr	1,5	5
14-févr	1,5	6	15-févr	1,5	6
21-févr	1,5	7	22-févr	1,5	7
28-févr	Semaine de travaux		01-mars	Semaine de travaux	
07-mars			08-mars	3	Examen
14-mars	1,5	8	15-mars	1,5	9
21-mars	1,5	10	22-mars	1,5	10
28-mars	1,5	11	29-mars	1,5	11
04-avr	1,5	12	05-avr	1,5	12
11-avr	1,5	13	12-avr	1,5	13
18-avr			19-avr	1,5	14
25-avr	1,5	14	26-avr	3	Examen
	18			27	

Commentaire: Il y aura 3 heures de cours mercredi le 25 janvier

---