

Certificat de compétence Statistique pour la finance

Présentation

Publics / conditions d'accès

Prérequis :

Niveau bac+2 (DEUG mathématiques).

Objectifs

Maîtriser les outils théoriques et le savoir-faire pratique (en particulier informatique) pour aborder les problèmes de modélisation et d'inférence dans le domaine financier.

Compétences

- Construire des modèles probabilistes pertinents pour formaliser les problèmes financiers les plus courants (gestion des portefeuilles, risque de taux, risque de crédit, valorisation de produits dérivés sur taux et sur actions, prévision des rendements et des volatilités, scoring).
- Estimer et tester des modèles probabilistes pertinents pour formaliser les problèmes financiers les plus courants.
- Écrire des programmes informatiques et utiliser des logiciels spécialisés.

🌟 Valide le 24-04-2019

Code : CC3100A

45 crédits

Certificat de compétence

Responsabilité nationale :

EPN06 - Mathématique et statistique / Elena DI BERNARDINO

Niveau d'entrée requis :

Sans niveau spécifique

Niveau de sortie : Sans

niveau spécifique

Mode d'accès à la certification :

NSF : Comptabilité, gestion (314)

Métiers (ROME) :

Contact national :

EPN06 Mathématiques et statistiques

2 rue conté

Accès 35 3 ème étage porte 19

75003 Paris

Sabine Glodkowski

formation.maths@cnam.fr

Enseignements

45 ECTS

Calcul des probabilités	STA103
	6 ECTS
Modélisation et prévision des séries chronologiques	STA107
	9 ECTS
Modélisation statistique	STA110
	9 ECTS
Gestion quantitative du risque en finance et assurance	STA217
	9 ECTS
Marchés financiers I : Produits de taux et gestion de portefeuille	GFN203
	6 ECTS
Marchés financiers II : Futures et options	GFN204
	6 ECTS