

DURÉE

35 heures de formation
10 demi-journée d'avril à juin

LIEU

Paris 5ème

DROITS D'INSCRIPTION

2 050 €

MATHÉMATIQUES FINANCIÈRES POUR L'ACTURIAT

Professionnel(les) de l'assurance, de la banque et de la finance. Contenu : révision des fondamentaux dans une optique d'application au contexte professionnel. Prérequis : niveau mathématique équivalent à un bac+3 à dominante mathématique. Connaissances élémentaires en probabilité



Caroline HILLAIRET
Professeure à l'Ensaie Paris

➤ OBJECTIFS

- Description des différents produits financiers et des mécanismes de marché,
- Évaluer les différents produits financiers (principes de valorisation des produits optionnels et des principaux instruments dérivés de taux non optionnels),
- Modélisation des produits financiers

➤ PROGRAMME

- Annuités et rentes, tableau d'amortissement,
- Taux d'intérêt : présentation du marché des produits de taux d'intérêt, principes, conventions, taux forwards, courbe de taux zéro-coupon,
- Calcul obligataire : caractéristiques, éléments de cotation, duration, mesure de sensibilité -
- Swaps : concept, présentation et éléments de valorisation, contexte d'utilisation.
- Introduction générale sur les produits dérivés,
- Concept d'absence d'opportunités d'arbitrage Parité call-put,
- Couverture des options
- Modèle discret de l'arbre binomial,
- Modèle en temps continu de Black-Scholes
- Contrat à terme sur action : valorisation des Forward, différence entre Futures et Forward

➤ EVALUATION

- Supports écrits dématérialisés,
- Évaluation sur les 10 questions écrites de l'épreuve d'accès au CEA,
- Remise d'une attestation individuelle de formation.

CONTACT

+(33)1 44 51 72 76

formation@institut-du-risk-management.fr

www.institut-du-risk-management.fr