



1 jour

Fiche d'inscription  
sur [www.caritat.fr](http://www.caritat.fr)

L'univers « R » et ses applications



## À qui s'adresse cette formation ?

Aux techniciens, responsables financiers, gestionnaires actif passif et risk managers dans les organismes assureurs. Aux étudiants en finance.

## Pour obtenir quoi ?

Capacité à modéliser les risques financiers, notamment dans le cadre de Solvabilité 2 (gestion des risques, ORSA).

## Comment ?

Nombreux exercices sur « R ». Introduction didactique et visuelle aux principales notions.

## Quels sont les pré-requis ?

Premières notions sous « R ».  
Principaux concepts financiers.

01 44 51 04 00  
[info@caritat.fr](mailto:info@caritat.fr)

## Qui anime cette formation ?



**Edouard HARDY,**  
Actuaire et Consultant  
au sein du Groupe Grant  
Thornton.

## Qu'allez-vous apprendre ?

### Découverte du langage

- Notion de package
- Interface graphique
- Objets sous « R »
- Importer/Exporter des données

### Capacité de modélisation

- Fonction
- Graphique
- Instructions conditionnelles et itérations

### R en finance

- Découverte des packages existants
- Mouvement brownien/Modèle de Black-Scholes
- Exploiter un historique de cours pour estimation une volatilité
- Simulation d'un indice (CAC40)
- Notion de VaR
- Modèle de taux
- Risques de spread
- Risques souverains

*Des exemples concrets seront déroulés tout au long de la formation, afin d'illustrer les concepts théoriques.*



Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**16 octobre 2017**

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30  
Caritat, Paris 8°

### Combien ça coûte ?

1 220 € HT + TVA 20 %, soit 1 464 € TTC.  
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

### Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :  
Elysées West Hôtel - 01 85 34 72 00  
Précisez que vous venez de la part de Caritat.  
<http://elysees.hotusa.com/caritat/>

## Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.

Cette formation est proposée en partenariat avec

