FINANCE STOCHASTIQUE SOUS « R »

1 jour

Fiche d'inscription sur www.caritat.fr

L'univers « R » et ses applications

Qu'allez-vous apprendre?



🛎 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

Qui anime cette formation?



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

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.

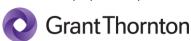
Où vous loger?

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





5 rue Tronchet - 75008 Paris Tél.: 01 44 51 04 00 - Fax: 01 44 51 04 09