

### Durée de la formation ?

1 jour – soit 7 heures.

### 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 II (gestion des risques, ORSA).

### Quels objectifs pédagogiques ?

Saisir le langage R.

**Maîtriser** l'utilisation du langage en finance.

**Illustrer** les possibilités par des exemples.

### Quelles méthodes mobilisées ?

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

### Quels sont les prérequis ?

Premières notions sous « R ». Principaux concepts financiers.

### Quelles modalités d'évaluation ?

Une évaluation des acquis des objectifs sera réalisée durant la formation.

### 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.*

### Qui anime cette formation ?

**Edouard HARDY,**  
Manager en actuariat chez  
Grant Thornton.



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

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

### La formation en pratique...

#### Quand et où ?

**6 novembre 2023**

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30  
Caritat, Paris 8<sup>e</sup>

#### Combien ça coûte ?

1 350 € HT + TVA 20%, soit 1 620 € TTC.  
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

### Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.

Cette formation est proposée en partenariat avec



Grant Thornton  
L'instinct de la croissance