CYCLES DE PERFECTIONNEMENT

MATHÉMATIQUES FINANCIÈRES POUR L'ACTUARIAT

Datadock

PUBLIC CONCERNÉ

- Professionnel(les) de l'assurance, de la banque et de la finance
- Révision des fondamentaux dans une optique d'application au contexte professionnel
- Niveau mathématique équivalent à un bac+3 à dominante mathématique
- Connaissances élémentaires en mathématiques générales

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

Première partie

- 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

Deuxième partie

- 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

MÉTHODES PÉDAGOGIQUES

- Supports écrits dématérialisés
- Exercices et présentation d'exemples d'application des méthodes sur logiciel
- Exercices à réaliser en dehors des sessions
- Cas pratique
- Remise d'une attestation individuelle de formation

MODALITÉS

- **Durée : 35 heures réparties sur 10 demi-journées d'avril à juin**
- Horaires : de 9h à 12h30 ou de 14h à 17h30
- Lieu : Paris intramuros
- Droits d'inscription pour 2019* : 1 910 €
- Formateur : Caroline HILLAIRET professeure à l'Ensae Paris-Tech
- Si vous êtes membre de l'IA cette formation vous rapportera

PDC 210

*(TVA non applicable cf. art 261-4-4 du CGI)

PLUS D'INFOS ?

formation@institutdesactuaires.fr

01 44 51 72 79

www.institutdesactuaires.com

IRM | institut du risk management

Déclaration d'activité enregistrée sous le numéro 11 75 44451 75 auprès du préfet de région IDF.
Cet enregistrement ne vaut pas agrément de l'État.