

## Gestion d'actifs et des risques

Présentation

### Public, conditions d'accès et prérequis

[Demandez un agrément à cette unité d'enseignement](#) et envoyez à [boris.buljan@lecnam.net](mailto:boris.buljan@lecnam.net)

Public niveau bac+4, possédant une formation en mathématiques appliquées, économétrie, économie, finance ainsi qu'une culture économique et financière par acquis professionnels.

### Présence et réussite aux examens

Pour l'année universitaire 2021-2022 :

Nombre d'inscrits : 84

Taux de présence à l'évaluation : 70%

Taux de réussite à l'évaluation : 51%

### Objectifs pédagogiques

Acquérir une connaissance des méthodes et des stratégies de gestion d'actifs et d'analyse des risques.

### Mots-clés

[Stratégie financière](#)

[Gestion de portefeuille](#)

[Marchés financiers et gestion des risques](#)

Programme

### Contenu

#### Gestion des risques financiers

Value at risk (risk metrics, Monte Carlo)

Risque de crédit

Contrôle des risques (banques et assurances).

#### Styles de gestion d'actifs

Analyse et recherche

Méthodes de sélection des valeurs (éléments de stock picking) et procédures d'allocation d'actifs

Stratégies concaves et convexes : assurance de portefeuille, gestion active, gestion avec benchmark.

Mesures globales de performance

Trois cas de simulation de stratégies de portefeuille et de calcul de la VaR

### Bibliographie

Parcours

## Cette UE apparaît dans les diplômes et certificats suivants

Chargement du résultat...



Intitulé de la formation	Type	Modalité(s)	Lieu(x)	Intitulé de la formation	Type	Modalité(s)	Lieu(x)
Intitulé de la formation	Type	Lieu(x)	Lieu(x)	Intitulé de la formation	Type	Modalité(s)	Lieu(x)
Intitulé de la formation	Type	Lieu(x)	Lieu(x)				
Intitulé de la formation	Type	Lieu(x)	Lieu(x)				

Informations pratiques

## Contact

EPN09 - département EFAB  
1D2P10, 40 rue des Jeûneurs  
75002 Paris  
Tel :01 58 80 87 45  
[Boris Buljan](#)  
Voir le site

[efab.cnam.fr/](http://efab.cnam.fr/)

**Voir le calendrier, le tarif, les conditions d'accessibilité et les modalités d'inscription dans le(s) centre(s) d'enseignement qui propose(nt) cette formation.**

UE

[Paris](#)

Centre Cnam Paris  
2023-2024 2nd semestre : Présentiel soir ou samedi

## Code UE : GFN206

Cours

6 crédits

Volume horaire de référence  
(+ ou - 10%) : **50 heures**

**Responsable(s)**

Alexis COLLOMB

Iryna VERYZHENKO

