

Probabilités et statistiques pour la finance

Présentation

Public, conditions d'accès et prérequis

Télécharger une demande d'agrément sur le site <http://efab-ms.cnam.fr/>, et la renvoyer.

Public niveau bac+4, ayant une formation mathématique supérieure à celle de 2 ans d'études scientifiques supérieures (DEUG scientifique, Math. spé., maîtrise d'économétrie...), et une culture économique et financière acquise lors d'études supérieures ou par acquis professionnels.

Présence et réussite aux examens

Pour l'année universitaire 2021-2022 :

Nombre d'inscrits : 24

Taux de présence à l'évaluation : 67%

Taux de réussite à l'évaluation : 75%

Objectifs pédagogiques

Maîtriser les outils classiques de la modélisation statistique pour les appliquer à la finance.

Mots-clés

[Analyse statistique des données](#)

[Modélisation statistique](#)

[Gestion financière](#)

[Finance](#)

[Analyse financière](#)

Programme

Contenu

Probabilités

Rappels : espace de probabilités, variables aléatoires, indépendance, conditionnement - Simulation de lois usuelles - Loi gaussienne multidimensionnelle - Théorèmes limites : loi des grands nombres, théorème central limite, delta méthode.

Statistique

Rappels : inférence dans le cadre de l'échantillonnage (estimation, intervalles de confiance et tests statistiques) - Présentation des modèles conditionnels statiques - Modèle linéaire : estimation, tests, prévision, modèle linéaire multivarié - Maximum de vraisemblance et applications.

Finance

Analyse statistique des rendements : rendement d'un portefeuille, performance de Sharpe - Statistique des choix de portefeuilles : approche moyenne-variance, analyse des portefeuilles par régression, test d'efficacité, modèle CAPM - Modèles à facteurs, absence d'opportunité d'arbitrage - APT.

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) .				
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 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

[2024-2025 1er semestre : Formation hybride soir ou samedi](#)

[2025-2026 1er semestre : Formation hybride soir ou samedi](#)

Comment est organisée cette formation ?

```
/**/ details.orga-container { display: list-item; } details.orga-container summary { display: list-item; margin: 0.5em; color: #c1002a; font-weight: bold; cursor: pointer; } details.orga-container .orga-subtitle { margin-left: 1em; } details.orga-container .orga-list { margin-left: 1em; margin-bottom: 1em; } details.orga-container h3 { font-size: 1.2em; } /**/
```

2024-2025 1er semestre : Formation Hybride soir ou samedi

Dates importantes

Période d'inscription : du 10/06/2024 à 10:00 au 18/10/2024 à 23:59

Date de 1ère session d'examen : la date sera publiée sur le site du centre ou l'ENF

Date de 2ème session d'examen : la date sera publiée sur le site du centre ou l'ENF

Précision sur la modalité pédagogique

Une formation hybride est une formation qui combine des enseignements en présentiel selon un planning défini et des enseignements à distance avec ou sans planning défini.

EN SAVOIR +

[S'INSCRIRE](#)

Code UE : GFN213

Cours

6 crédits

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

Responsable(s)

Alexis COLLOMB

Henri BERTHOLON