

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
 2023-2024 1er semestre : Présentiel soir ou samedi

Code UE : GFN213

Cours

6 crédits

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

Responsable(s)

Alexis COLLOMB

Henri BERTHOLON