

## Parcours

- Gestion des risques financiers

## Lieu(x) de la formation

- Autre\*\*\*\*

[CY Tech économie et gestion](#)

## Présentation

Les masters 1re année finance ([pour information et candidature, cliquer ici](#)) et économie ([pour information et candidature, cliquer ici](#)) préparent à une poursuite d'études en master 2e année gestion des risques financiers.

Le master 2e année gestion des risques financiers délivre une formation de haut niveau dans plusieurs champs aujourd'hui très complémentaires : la finance de marché, finance d'entreprise, l'assurance et la gestion des risques.

[Maquette de présentation du Master 2ème année Gestion des risques financiers 20-21](#)

Ces domaines sont aujourd'hui étroitement liés, comme en témoignent par exemple l'importance croissante de la réassurance financière, les nouveaux mécanismes de couverture des risques catastrophiques, le développement du risk management dans les entreprises ou l'essor de la banque-assurance. Les enseignements proposés dans le cadre de ce master sont au cœur de cette évolution.

Le programme du master accorde une importance toute particulière aux problèmes du risque dans leur diversité : risques individuels ou collectifs, perception du risque et assurabilité, risques spécifiquement financiers (risques de marché, de crédit et opérationnels, mesures de risque (théorie et estimation)

Enfin, les métiers de la finance, notamment la finance de marché, requièrent aujourd'hui des compétences approfondies dans les domaines de l'analyse quantitative et de la modélisation des marchés financiers.

Le master gestion des risques financiers fournit ainsi une formation avancée en microéconomie de l'incertain, en théorie de la finance de marché et en économétrie financière, en méthodes d'évaluation et de gestion des risques financiers. Notons également que les travaux de recherche de nature théorique ou empirique en finance tiennent une place majeure dans les activités du THEMA. Ceci favorise la formation des étudiants en leur garantissant la pertinence (qualité et actualité) des cours et encadrements proposés.

[Présentation complète](#)

## Enjeux

### Savoir-faire et compétences

N°	Compétences	Thèmes
1	Evaluer les prix des actifs dérivés et élaborer leurs couvertures	Finance de marché
2	Développer l'économétrie des variables financières	
3	Mettre en place les instruments de gestion de portefeuille	
4	Analyser les produits structurés et mesurer leur adéquation	
5	Concevoir et mettre en place les décisions en matière d'investissement	Finance d'entreprise
6	Evaluer et contrôler les ratios standards de gestion	
7	Développer les calculs de la VAN à l'aide des différents concepts d'options réelles	
8	Réaliser des études concernant la détermination des Value-at-Risk pour contrôler les différentes classes de risque	Gestion des risques financiers
9	Développer les outils statistiques nécessaires à la mise en œuvre des accords de Bâle III	
10	Améliorer le traitement des données dans le cadre du reporting des incidents	
11	Elaborer des outils d'aide à la décision et de mesure de performance des activités financières	

## Admission

### Pré-requis

#### Formation(s) requise(s)

La sélection des étudiants se fait sur dossier. **La capacité d'accueil est de 30 étudiants.**

Les étudiants proviennent des universités (master 1 d'économétrie, d'économie mathématiques, de sciences économiques et d'économie appliquée) ou des grandes écoles (d'ingénieurs ou de commerce).

Les masters 1re année finance ([pour information et candidature, cliquer ici](#)) et économie ([pour information et candidature, cliquer ici](#)) préparent à une poursuite d'études en master 2e année gestion des risques financiers.

#### Critères d'examen des dossiers:

**Cible prioritaire** : étudiant(e)s venant du Parcours EGR Evaluation et Gestion des Risques ( formation initiale ) option 1 Finance mathématiques et marchés.

**Critères académiques en finance** : il est conseillé d'avoir obtenu les notes suivantes en M1 finance (EGR, Option 1 ) :

- Modélisation stochastique en finance 10
- Développement C++ 10

Pour tous les autres étudiants, le recrutement sera effectué sur la base d'un classement

après examen des dossiers de candidatures et en fonction des places restant disponibles.

## **Candidature**

### **Modalités de candidature**

Pour postuler au Master 2ème année Gestion des Risques Financiers 2021-2022 :

**les candidatures seront à déposer du 2 avril au 22 juin 2021 sur [E-candidat](#).**

Les dossiers non complets à la date limite de dépôt des dossiers via e-candidat ne seront pas étudiés.

La communication des résultats d'admission après décision du jury se fera par voie électronique.

Aucun résultat ne sera communiqué par téléphone.

# Programme

## Programme de la deuxième année

### PROGRAMME

#### Semestre 1 : enseignements théoriques (cours fondamentaux obligatoires - 30 ECTS)

- \* finance d'entreprise I > 20h / 3
- \* mathématiques appliquées à la finance > 40h / 4
- \* méthodes numériques en finance I > 20h / 3
- \* principes de finance moderne > 30h / 3
- \* gestion de portefeuille I > 20h / 4
- \* stratégie sur actions > 20h / 3
- \* séries temporelles > 20h / 3
- \* gestion des risques financiers > 20h / 4
- \* microéconomie des marchés financiers et de l'assurance > 20h / 3

#### Semestre 2 : enseignements de spécialisation (30 ECTS)

Cours obligatoire :

- \* anglais, préparation au TOEIC > 30h / 3

cours à choisir pour un total de 12 ECTS : soit 4 cours à 3 ECTS

- \* mesures de risques : théorie et applications > 20h / 3
- \* gestion de portefeuille II > 20h / 3
- \* économétrie de la finance > 20h / 3
- \* options exotiques et applications > 20h / 3
- \* finance d'entreprise II > 20h / 3
- \* initiation VBA > 20h / 3
- \* finance comportementale > 20h / 3
- \* gestion obligataire > 20h / 3

**Pour la filière professionnelle** : stage (de 3 à 6 mois) donnant lieu à un rapport de stage et soutenance > 15

**Pour la filière recherche** :

- \* mémoire mineur (revue de la littérature ou application numérique) > 5
- \* mémoire majeur (conduisant potentiellement à une publication) > 10