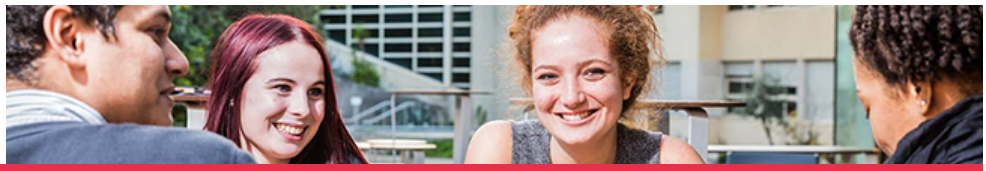

Analyse des risques de marchés (MENTION MBFA)

ECTS
120 crédits

Durée
2 ans

Structure de formation
Faculté d'économie

Langue(s) d'enseignement
Français

Présentation

Ce parcours permet de former des professionnels aux métiers de la finance de marché et des chercheurs spécialisés dans ce domaine. Il propose un enseignement spécialisé dans les domaines théoriques et quantitatifs relatifs aux produits négociés sur les marchés financiers. Il aborde notamment la détermination de la gestion des risques par l'association de méthodes statistiques.

Ce parcours s'inscrit dans la continuité de ce qui a été fait jusqu'à l'année universitaire 2020-2021 avec des évolutions qui permettent l'intégration des mutations des métiers d'analystes de risque. Il s'agit en particulier d'intégrer les contraintes réglementaires de Bâle III dans la mesure des risques de marché (Calcul de la Value at Risk (VaR), de l'Expected shortfall (ES), et leur validation (backtesting). L'objectif étant de doter les étudiants d'outils performants de mesure et de couverture des risques auxquels sont confrontés les institutions financières (Banques et Assurances). Les compétences acquises à l'issue de leur formation en analyse des risques de marché, ls étudiants pourront intégrer les directions de contrôle des risques.

Objectifs

L'objectif est de se différencier par rapport à l'offre régionale (sur Montpellier et Toulouse). Le parcours analyse des risques de marché au sein de la mention MBFA s'assigne comme objectif de développer chez les étudiants des compétences quantitatives (statistiques, économétrie, méthodes numériques), ainsi que des compétences en informatique et programmation (VBA, R, SAS, Python).

Sur le plan national, il se positionne en concurrence avec les Masters Finance de l'Université de Dauphine et avec les écoles d'ingénieurs.

Les objectifs principaux sont :

* Approfondir les enseignements en économie financière et en économie.
* Acquérir une maîtrise de l'organisation, du fonctionnement des produits financiers les plus courants (actions, obligations…) ainsi que celle des marchés spéculatifs (énergie, matières premières, produits de base …).
* Acquérir une formation technique basée sur la manipulation des grandes bases de données financières aux fréquences multiples, associée aux logiciels informatiques les plus puissants.
* Se sensibiliser aux récentes techniques des métiers liés à la bourse.

Organisation

Aménagements particuliers

Aménagements d'études et d'examens possibles pour les étudiants reconnus en situation d' handicap et / ou sportifs de haut niveau.

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 03 octobre 2024

Admission

Conditions d'accès

CANDIDATURES :

* + d'infos

Modalités d'inscription

L'inscription s'effectue en période d'inscription après un avis favorable à une candidature au Master.

Capacité d'accueil

40 étudiants en première année de Master

30 étudiants en deuxième année de Master

Et après

Insertion professionnelle

Ce master est à finalité professionnelle et débouche sur un emploi. Une poursuite d'études en doctorat est envisageable sous réserve de la qualité du mémoire de recherche appliquée.

Cette formation est destinée à former des **cadres de haut niveau** faisant carrière **au sein des banques, des acteurs du private equity (capital risque), des cabinets d'audit et de conseil et des grandes entreprises.**

Les diplômes du parcours Analyse des risques de marché arrivent souvent à décrocher des CDI à l'issue de leur stage dans les directions de risque en BANQUE, en Assurance ou chez des entreprises de gestion d'actifs. Certains des étudiants arrivent même à s'expatrier (à Londres, à Hong Kong, à Tokyo, à New York) dans le cadre de contrats de travail offrant des responsabilités et des salaires très importants.

Certains étudiants préfèrent s'orienter vers la **recherche dans le cadre de thèse de doctorat**.

Infos pratiques

Contacts

Responsable pédagogique

Francois Benhmad

+33 4 34 43 25 02

francois.benhmad@umontpellier.fr

Contact administratif

Scolarité Master

eco-scolarite-master@umontpellier.fr

Lieu(x)

Montpellier - Faculté d'Économie

En savoir plus

Faculté D'Economie

https://economie.edu.umontpellier.fr/

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 03 octobre 2024

Programme

Organisation

Voir modalités de contrôle de connaissance

S1M1ARM

Anglais de la Finance 1	2 crédits
Espagnol 1	
Econométrie théorique	5 crédits
Finance de marché	4 crédits
Macroéconomie monétaire et financière	3 crédits
Méthodes de prévision	5 crédits
Algorithmique et Programmation	3 crédits
Fouille de données et big data	
Entrepôt de données	
Economie de la Bancassurance	3 crédits

S2M1ARM

Introduction au calcul stochastique	4 crédits
Valorisation d'actifs	3 crédits
Finance d'entreprise	4 crédits
Introduction à SAS	2 crédits
Allocation de portefeuille	3 crédits
Econométrie des séries temporelles	5 crédits
Analyse technique	2 crédits
Projet d'économétrie appliquée	5 crédits

Engagement étudiant UM

Anglais de la finance 2	2 crédits
Espagnol 2	2 crédits

S3M2ARM

Méthodes numériques	3 crédits
Marchés financiers et théorie financière	2 crédits
Programmation sur VBA	1 crédits
Calcul stochastique	2 crédits
Gestion de portefeuille	4 crédits
Anglais de la finance	1 crédits
Algorithmes de trading	2 crédits
Data mining et big data	3 crédits
Statistiques exploratoires (SAS)	1 crédits
Techniques informatiques (VBA)	1 crédits
Risques de marché	4 crédits
Econométrie de la finance	2 crédits
Programmation sur R, Python	1 crédits

S4M2ARM

Conférenciers professionnels

Séminaires d'initation à la recherche

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 03 octobre 2024