



# EXECUTIVE EDUCATION

## EXECUTIVE MASTER FINANCE QUANTITATIVE



### L'excellence technique pour les professionnels de la finance et de la gestion des risques

L'Executive Master Finance Quantitative est un double diplôme unique, délivré par l'Université Paris Dauphine-PSL et l'ENSAE Paris, consacré aux techniques quantitatives en finance et gestion des risques. De niveau Bac+5, le cursus de formation est conçu pour les professionnels et structuré en trois niveaux.

Il a pour ambition de permettre aux personnes déjà en poste et ayant une base minimum en mathématiques d'évoluer dans leur secteur de la finance quantitative, de perfectionner et valider leurs connaissances et savoir-faire.

L'Executive Master a été conçu conjointement par l'Université Paris Dauphine-PSL, l'[ENSAE Paris](#) et l'organisme de formation continue [Lefebvre Dalloz](#). L'alliance de ces trois établissements garantit un niveau d'excellence pour chacun des cours et une formation connectée à la réalité de la finance contemporaine.

Les intervenants sont issus du monde professionnel et des enseignants(-chercheurs) de Dauphine-PSL et du Groupe des Ecoles Nationales d'Economie et Statistique (GENES).

#### NOS PARTENAIRES



Lefebvre Dalloz  
ACTIVER LA CONNAISSANCE



#### CONTACT

Ashley Eloundou  
01 83 10 10 10  
[info@difiq.com](mailto:info@difiq.com)

#### RESPONSABLE(S) FORMATION

Antonin Chaix  
Bruno Bouchard

**Dauphine** | PSL   
EXECUTIVE EDUCATION

30/04/2026



## DURÉE

81 jours / 243 heures sur 16 mois

## DATE DE DÉMARRAGE

Le mardi 9 mars 2027

## RYTHME

Cours du soir (18h30-21h30) tous les mardis et certains jeudis + 1 mardi ou 1 jeudi par mois (9h30-16h30)

## LIEU(X)

PariSanté Campus (Paris 75015), ou à distance, sauf pour les examens en présentiel uniquement à Paris 15e

## PÉRIODE

Formation en 3 niveaux de 81h chacun (27 séances de 3h) de mars année n à juillet année n+1.

- Niveau 1 : mars – juillet
- Niveau 2 : septembre – février
- Niveau 3 : mars – juillet

## DATE LIMITE DE CANDIDATURE

02/03/2027

## TARIF NET DE TAXES

14 450 €

## DIPLÔME OU CERTIFICAT DÉLIVRÉ

\* L'Executive Master est un Diplôme d'Université (DU) de niveau BAC+5 validé par le conseil d'administration de l'Université Paris Dauphine-PSL

## OBJECTIFS DE LA FORMATION

- Gagner une maîtrise incontournable des techniques quantitatives en finance et gestion des risques. L'approche des mathématiques financières permet aux participants d'accéder à une maîtrise de la valorisation des produits financiers aussi bien que des techniques de gestion des risques au sein des établissements financiers et en gestion d'actifs.
- Acquérir une expertise théorique, mais aussi assimiler l'état de l'art des techniques quantitatives à l'œuvre aujourd'hui au sein des établissements financiers, en bénéficiant des apports d'intervenants professionnels.
- Faciliter son évolution de carrière au sein des services de négociation et d'ingénierie financière, de middle et front office et de gestion des risques, mais aussi d'ALM et de gestion d'actifs.
- Valoriser son expérience avec un double diplôme prestigieux Dauphine-PSL – ENSAE Paris

## PUBLIC

- ITs front office voulant progresser sur les aspects quantitatifs / fonctionnels
- Consultants du secteur bancaire souhaitant évoluer vers des missions de finance quantitative
- Risk-managers. Structureurs. Chargés de suivi des positions de marché (middle office)
- Asset managers souhaitant évoluer vers des gestions quantitatives

## PROCÉDURE DE CANDIDATURE

### Pré-requis

Les candidats doivent justifier d'une expérience professionnelle d'au moins 1 an et d'un niveau d'études au moins équivalent à Bac+4.

### Procédure de candidature

#### Pièces à joindre :

- un CV
- une lettre de motivation

[Déposer ma candidature par mail](#)



# PROGRAMME

---

## LES FONDAMENTAUX MATHÉMATIQUES POUR LA FINANCE

15 HEURES

- Quelques rappels en Analyse et Algèbre
- Comprendre les concepts essentiels en probabilité, pour être « à l'aise » face à la modélisation
- Introduction à la statistique mathématique

---

## LES PRODUITS FINANCIERS

36 HEURES

- Les produits de taux
- Les options
- Les produits de change et de crédit

---

## INTRODUCTION À LA GESTION DES RISQUES

15 HEURES

- Les fondamentaux
- La Value at Risk
- Stress tests
- Moteurs d'évaluation du risque de crédit

---

## GESTION DE PORTEFEUILLE

15 HEURES

- Indicateurs de performance
- Allocation de portefeuille selon la théorie moderne de Markowitz
- Aspects statistiques et mise en pratique

---

## INTRODUCTION AU CALCUL STOCHASTIQUE POUR LA FINANCE

30 HEURES

- Processus et martingales en temps discret : application au modèle de Cox-Ross-Rubinstein
- Le mouvement brownien et le modèle de Black et Scholes
- L'intégrale stochastique et le calcul d'Itô : application à la couverture et à l'évaluation d'options
- Un peu de contrôle optimal stochastique : application à la gestion de portefeuille

---

## MODÉLISATIONS AVANCÉES, PRODUITS ET RISQUES EXOTIQUES

12 HEURES

- Choix de modèle : une étape cruciale
- Les différents types d'option et les risques associés
- Smile de volatilité et modèles à volatilité locale
- Modèles à volatilité stochastique

---

## STATISTIQUE

18 HEURES

- Analyse des données
- Régression
- Séries temporelles

# MÉTHODES NUMÉRIQUES

21 HEURES

- Génération de variables aléatoires
- Simulation de processus stochastiques
- Méthode de Monte-Carlo et de réduction de variance
- Résolution numérique des équations aux dérivées partielles
- Etude de cas concrets en finance

---

## FINANCE QUANTITATIVE AVANCÉE

- Taux - Modélisations avancées - 15h
- CVA et Risque de contrepartie - 12h
- Gestion des risques avancée : stress test et mesures de risque - 12h
- Stratégies quantitatives de gestion d'actif - 9h
- Structuration et gestion des risques des produits structurés - 9h
- Contrôle optimal : application au trading et au passage d'ordres - 9h
- Machine learning - 9h
- Cycle de conférences : Hot topics - 6h

---

## CONTRÔLE DES CONNAISSANCES

La validation des acquis des enseignements de chaque module de l'Executive Master Finance Quantitative se fait au travers d'un QCM.

30/04/2026