

Mathématiques financières

ECTS : 2

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours permet une initiation à la finance et un apprentissage des concepts mathématiques de base de ce domaine.

Contenu :

1. Opérations financières à court terme et marché monétaire ;
2. Opérations financières à long terme et actualisation-capitalisation ;
3. Techniques de choix d'investissement en avenir certain ;
4. Marché obligataire : définitions, évaluation des obligations, duration et sensibilité ;

Alternance de cours théoriques et d'exercices d'application.

Compétence à acquérir :

A l'issue de ce cours, les étudiants doivent pouvoir résoudre par eux-mêmes tous les problèmes d'actualisation et de capitalisation classiques.

Cette option est utile pour une poursuite d'études en magistère BFA.

Mode de contrôle des connaissances :

1 Test écrit par semestre

Bibliographie, lectures recommandées :

M. Ginglinger, Mathématiques financières Cours et exemples – Gestion Poche Economica. M. Boissonade, Mathématiques financières Cours et exercices, Flash U. GROUPE ESSEC, Mathématiques financières, évaluation des actifs et des risques DALLOZ

Document susceptible de mise à jour - 05/02/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16