

Statistiques et dynamique des produits dérivés

**ECTS** : 2

**Volume horaire** : 21

**Description du contenu de l'enseignement :**

1/ Approches en probabilité historique (gestion de portefeuille classique), portefeuilles optimaux, beta, arbitrage, APT

2/ Valuation de produits dérivés et probabilité risque neutre

3/ Trading de volatilité, volatilité locale et calibration

4/ Assurance du portefeuille: stop-loss, options, CPPI, CRP - Constant Mix

5/ Options exotiques ou cachées: ETF short, etc.

**Compétence à acquérir :**

approche pratique et empirique des produits dérivés et de la gestion de risques tout en se basant sur une formalisation stochastique avancée

**Bibliographie, lectures recommandées :**

Voir <https://turinici.com>

**Document susceptible de mise à jour - 11/02/2026**

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