Finance des marchés 2

ECTS : 3

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Il s'agit d'implémenter sur Python des problèmes classiques en finance. En particulier:
Calibration et implémentation du modèle de Black et Scholes, calcul de la volatilité implicite.
Gestion de portefeuille: calcul de portefeuilles optimaux, frontière efficiente.
Sur-réplication de payoff Européens sans probabilité de risque neutre à partir d'un historique.
Calcul de mesures de risques (VAR, CVAR).

Compétence à acquérir :

Savoir comprendre et implémenter des modèles en finance.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen terminal.