Méthodes quantitatives pour la finance

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

1. Propriétés statistiques des rendements financiers
2. Construction de portefeuilles et optimalité
3. Asset pricing et CAPM
4. Evaluation des produits dérivés – temps discret
5. Evaluation des produits dérivés – temps continu

Compétence à acquérir :

Maîtrise des concepts théoriques et empiriques des modèles d'évaluation d'actifs financiers

Mode de contrôle des connaissances :

QCM