

Implémentation de modèles multivariés en finance et assurance

ECTS : 2

Volume horaire : 18

Description du contenu de l'enseignement :

La dépendance à travers les copules, applications dans divers problèmes, mesures de risques dans des problèmes multivariés, problème de sur-réplication dans des problèmes multivariés. Divers exemples d'implémentations numériques multi-dimensions.

Compétence à acquérir :

Savoir modéliser un problème issu de la finance ou de l'assurance, savoir le résoudre et l'implémenter en Python.

Mode de contrôle des connaissances :

CC (30%)+examen final (70%)

Bibliographie, lectures recommandées :

Le cours est auto-suffisant.

Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026

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