

Modélisation mathématique des produits en finance et assurance

ECTS : 3

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Marchés obligataires sans risque de défaut (Pricing, courbes de taux..), modèles stochastiques en finance de marché (modèles à volatilité locale et pricing d'options Européennes), gestion de portefeuille (théorie de Markowitz).

Compétence à acquérir :

Comprendre la théorie et savoir implémenter les modèles en Python.

Mode de contrôle des connaissances :

CC (30%)+ Examen (70%)

Bibliographie, lectures recommandées :

Cours auto-suffisant

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

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