

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

**Document susceptible de mise à jour - 30/05/2026**

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