Microéconomie financière statique

ECTS : 4

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

- I - L'approche moyenne-variance : théorie du portefeuille, frontière efficiente, MEDAF
- II - L'évaluation des actifs par absence d'opportunité d'arbitrage : marchés complets et introduction au marchés incomplets.

Compétence à acquérir :

- Comprendre le compromis fondamental entre risque et rentabilité
- Comprendre la notion de frontière efficiente et le MEDAF, notamment la distinction entre risque et risque non diversifiable
- Savoir évaluer un actif par mesure risque-neutre et par réplication en marchés complets
- Comprendre le premier et le deuxième théorème fondamental de l'évaluation des actifs

Mode de contrôle des connaissances :

- Examen final écrit sur table 100% (50% sur la première partie du cours et 50% sur la seconde)

Bibliographie, lectures recommandées :

- Economie Financière, François Etner et Thierry Granger, Economica
- Economie financière- 64 exercices corrigés, François Etner, Thierry Granger et Frédéric Loss, Economica.

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16