Produits dérivés et gestion des risques

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

1. Rappel du modèle binomial, notion de probabilité risque neutre.
2. Théorie de l’arbitrage dans un modèle à une période.
3. Marché complet et unicité de la probabilité risque neutre.
4. Sélection de probabilité risque neutre via la maximisation d’utilité.
5. Théorie de l’arbitrage dynamique (multi-périodes).
6. Options Américaines.

Compétence à acquérir :

Présenter les méthodes de mesure et d’analyse des stratégies de gestion des produits dérivés et des risques financiers.

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