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 - 05/11/2026

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