

# SÉMINAIRE QUANTACT

**Frédéric Godin**

HEC Montréal

*Couverture de risques (hedging) avec la programmation dynamique*

**Résumé:** Un algorithme de programmation dynamique est utilisé pour trouver la solution optimale à un problème de couverture de risques global. Un exemple numérique est présenté.

**Vendredi 9 novembre 2012, 13:30-14:30**

**PK-5115**

**Département de mathématiques, UQAM**