

Modélisation Stochastique en Finance

Objectif du cours :

Connaître les notions de base de calcul stochastique, modèles de la finance et méthodes d'évaluation d'options.

Pré-requis :

Connaissance en probabilités (notion de tribu, ensemble mesurable, etc.)

Programme détaillé :

- Notions de base de probabilités.
- Processus stochastiques (processus de Poisson, mouvement Brownien).
- Modèles financiers de base à temps discret et à temps continu.
- Théorèmes fondamentaux en probabilités
- Evaluation d'options.

Bibliographie :

- Lambertson et Lapeyre, Introduction au calcul stochastique appliqué à la finance, Ellipses 2012 (3e édition).