

Calcul stochastique

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

- Introduction au calcul stochastique appliqué à la finance.
 - Fournir une approche d'ingénierie à l'arbitrage financier.
- Chapt 1: Structures probabilistes et stochastiques.
Chapt 2: Modélisation stochastique d'un marché financier dont les modèles binomiaux.
Chapt 3: Passage du temps discret au temps continu.
Chapt 4: Intégrale stochastique.
Chapt 5: Le modèle de Black et Scholes.

Compétence à acquérir :

- Familiarisation avec les modèles stochastiques pour la finance.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen final

Bibliographie, lectures recommandées :

Quantitative Finance For The Beginners: Stochastic Models and European and Asian Options Pricing . Author: Emmanuel Lépinette.