Modélisation stochastique des courbes de taux

ECTS : 3

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

1. Quelques outils de calcul stochastique : rappels
2. Généralités sur les taux d'intérêt
3. Produits de taux classiques
4. Modèle LGM à un facteur
5. Modèle BGM (Brace, Gatarek et Musiela) / Jamishidian
6. Modèles à volatilité stochastique

Compétence à acquérir :

Ce cours est consacré aux modèles de taux d'intérêts à temps continu. Au travers de nombreux exemples, on décrira leurs utilisations pour évaluer les produits dérivés sur taux d'intérêt.