Projet Programmation financière

ECTS : 1.5

Volume horaire : 12

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours projet traite du problème d'implémentation des modèles de valuation des produits dérivés financiers.

Il s'agira de mettre en application les modèles de pricing présentés en finance de marché. Ce cours-projet abordera tout particulièrement la méthode de Monte-Carlo et son implémentation en Python afin d'évaluer des options Européennes et Asiatiques dans des modèles à volatilité locale.

Compétence à acquérir :

Programmation en Python des méthodes de pricing vues dans le cours Finance de Marché.

Mode de contrôle des connaissances :

Contrôle sous la forme d'un TP.