

Processus Stochastique

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Introduction au calcul stochastique

-Outils probabilistes.

- Introduction aux processus stochastiques.

- Maîtriser les principes élémentaires du calcul stochastique.

- Applications à l'évaluation des dérivés et à la simulation des prix des actifs financiers.

-Programmation en Python; méthodes de Monte Carlo.

Compétence à acquérir :

-Modélisation de la dynamique des prix d'actifs financiers dans le cadre de modèles de marchés stochastiques.

- Pricing d'options.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen final + CC.

Bibliographie, lectures recommandées :

<https://www.amazon.com/Quantitative-Finance-Beginners-Stochastic-European/dp/B0C6BMGWGH>

Document susceptible de mise à jour - 18/02/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16