Processus Stochastique

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Introduction au calcul stochastique

-Outils probabilistes.
- Introduction aux processus stochastiques.
- Maitriser 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