

Stochastic Finance

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

1. Introduction aux processus de diffusion et lien avec les équations aux dérivés partielles; 2. Modèle de Black et Scholes; 3. Modèles à volatilité locales et volatilité stochastique; 4. Introduction aux modèles de taux

Compétence à acquérir :

Modélisation stochastique (Modèles de diffusion) en Finance et application à l'évaluation et couverture des produits dérivés