

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

**Document susceptible de mise à jour - 06/02/2026**

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