

Modélisation stochastique de la courbe de taux

ECTS : 6

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

1. Quelques outils de calcul stochastique : rappels 2. Généralités sur les taux d'intérêt 3. Produits de taux classiques 4. Modèle LGM à un facteur 5. Modèle BGM (Brace, Gatarek et Musiela) / Jamishidian 6. Modèles à volatilité stochastique

Compétence à acquérir :

Ce cours est consacré aux modèles de taux d'intérêts à temps continu. Au travers de nombreux exemples, on décrira leurs utilisations pour évaluer les produits dérivés sur taux d'intérêt.

Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026

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