

Evaluation des actifs financiers en temps continu

**ECTS** : 3

**Description du contenu de l'enseignement :**

1. Principe de l'évaluation par réplication en absence d'opportunités d'arbitrage, 2. Outils de calcul stochastique en temps continu (mouvement Brownien, calcul d'Itô), 3. Application au modèle de Black & Scholes

**Compétence à acquérir :**

Introduction à la modélisation stochastique en Finance, application à l'évaluation et couverture des produits dérivés

**Document susceptible de mise à jour - 31/05/2026**

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