

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 :

CC sur table (30%)+Examen (70%).

Document susceptible de mise à jour - 30/05/2026

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