Evaluation des actifs financiers en temps continu

ECTS : 3

Enseignant responsable : Imen BEN TAHAR (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/ben-tahar-imen)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

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

Compétences à acquérir :

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

Pré-requis obligatoires

Bases en probabilités (espace de probabilité, tribu, mesure de probabilité, espérance, espérance conditionnelle)

Pré-requis recommandés

Processus stochastique en temps discret, martingales en temps discret, modèles binomiaux pour l'évaluation d'options

Coefficient : 2.00

Document susceptible de mise à jour - 04/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16