Stochastic Finance

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. 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

Compétences à acquérir :

Modélisation stochastique (Modèles de diffusion) en Finance et application à l'évaluation et couverture des produits dérivés

Pré-requis obligatoires

Bases en calcul de probabilité (variables aléatoire, espérance, espérance conditionnelle)

Pré-requis recommandés

Bases de calcul stochastique en temps continu (martingales, mouvement Brownien) ; Modèle de Black & Scholes pour l'évaluation et la couverture de produits dérivés.

Coefficient : 1.00

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