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 - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16