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