

5.0 crédits

30.0 h + 22.5 h

1q

Enseignants:	Devolder Pierre ;
Langue d'enseignement:	Français
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Acquis d'apprentissage	-- Comprendre les principes de base de la finance quantitative -- Maîtriser les techniques du calcul stochastique -- Appliquer le calcul stochastique et la tarification financière et la détermination de stratégies d'investissement <i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	1/5ème : projet et fin de quadri 4/5èmes : examen écrit en session - sans notes avec formulaire
Contenu :	-- Intro : actif sans risque -- Partie 1 : théorie du portefeuille -- Partie 2 : actif risque dynamique -- Partie 3 : calcul stochastique -- Partie 4 : tarification financière en temps continu -- Partie 5 : stratégies optimales d'investissement
Bibliographie :	Capinski / Zastawniak : Mathematics for Finance (Springer, 2003) Wiersena : Brownian Motion Calculus (Wiley, 2008)
Autres infos :	Slides disponibles sur iCampus
Cycle et année d'étude :	> Master [120] : ingénieur civil en mathématiques appliquées > Master [120] en sciences actuarielles > Master [120] en statistiques, orientation générale > Master [120] en sciences mathématiques
Faculté ou entité en charge:	MAP