

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	<p>--</p> <p>Comprendre les principes de base de la finance quantitative</p> <p>--</p> <p>Maîtriser les techniques du calcul stochastique</p> <p>--</p> <p>Appliquer le calcul stochastique et la tarification financière et la détermination de stratégies d'investissement</p> <p><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></p>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	<p>1/5ème : projet et fin de quadri</p> <p>4/5èmes : examen écrit en session - sans notes avec formulaire</p>
Contenu :	<p>--</p> <p>Intro : actif sans risque</p> <p>--</p> <p>Partie 1 : théorie du portefeuille</p> <p>--</p> <p>Partie 2 : actif risque dynamique</p> <p>--</p> <p>Partie 3 : calcul stochastique</p> <p>--</p> <p>Partie 4 : tarification financière en temps continu</p> <p>--</p> <p>Partie 5 : stratégies optimales d'investissement</p>
Bibliographie :	<p>Capinski / Zastawniak : Mathematics for Finance (Springer, 2003)</p> <p>Wiersena : Brownian Motion Calculus (Wiley, 2008)</p>
Autres infos :	Slides disponibles sur iCampus
Cycle et année d'étude :	<p>> Master [120] en sciences mathématiques</p> <p>> Master [120] en sciences actuarielles</p> <p>> Master [120] : ingénieur civil en mathématiques appliquées</p> <p>> Master [120] en statistiques, orientation générale</p>
Faculté ou entité en charge:	MAP