

Calcul Stochastique et Applications à la Finance: L3 MASS 2008-2009

	Cours (Amphi M) 8h15-10h00		TP salles 214 et 215 Lundi 13h15-15h (Groupe 1) et Lundi 15h15-17h ou Mercredi 13h15-15h (Groupe 2)		
Semaine 1 (19/01)	Prix et couverture d'une option d'achat	Me 21		Gr 1	Gr 2
Semaine 2 (26/01)	Le modèle Cox-Ross-Rubinstein	Me 28	La marche aléatoire de Cox-Ross-Rubinstein	Lu 26	Lu 26
Semaine 3 (02/02)	Filtration et information	Me 04	Calcul de la prime d'un Call et d'un Put	Lu 02	Me 04
Semaine 4 (09/02)	Espérance conditionnelle	Lu 09	Calcul de prix par espérance conditionnelle	Lu 09	Me 11
Semaine 5 (16/02)	Martingales et P&P	Lu 16	Filets des Call et Put européens	Lu 16	Me 18
Vacances (23/02)					
Semaine 6 (02/03)	Marchés complets et sans arbitrage	Lu 02	Etude du Delta de couverture	Lu 02	Me 04
Semaine 6 (02/03)	Options barrières	Me 04			
Semaine 7 (9/03)			Options barrières et parisiennes	Lu 09	Me 11
Semaine 8 (16/03)	Options américaines	Me 18	Prix d'un Put américain	Lu16	Lu16
Semaine 9 (23/03)	Théorème d'arrêt optimal	Lu 23	Frontière d'exercice du put américain	Lu 23	Lu 23
Semaine 10 (30/03)	Black-Scholes comme limite de CRR	Lu 30	Etude de la convergence de BS vers CRR	Lu 30	Lu 30
Semaine 11 (06/04)	Modèle de taux Ho et Lee	Lu 06	Modèle de Taux de Ho et Lee	Lu 06	Lu 06
Semaine 12 (13/04)	Introduction à la micro finance	Je 16			
semaine 13 (20/04)			Prix de cap et de floor, swaps	Lu 20	Lu 20