



Valorisation des produits dérivés

 **Télécharger**

 **Lire En Ligne**

[Click here](#) if your download doesn't start automatically

Valorisation des produits dérivés

Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX

Valorisation des produits dérivés Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX

 [Télécharger Valorisation des produits dérivés ...pdf](#)

 [Lire en ligne Valorisation des produits dérivés ...pdf](#)

Téléchargez et lisez en ligne Valorisation des produits dérivés Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX

304 pages

Présentation de l'éditeur

Ce livre propose un panorama complet des fondamentaux mathématiques de l'évaluation des actifs financiers et de la couverture des produits dérivés. La théorie abstraite de l'évaluation des actifs est présentée en détail dans un cadre général de modèles en temps discret avant d'être étendue aux modèles en temps continu. Il présente ensuite de manière approfondie les techniques de couverture appliquées dans les modèles markoviens : en marché complet, en marché incomplet ou en présence de contraintes de portefeuille. L'étude s'appuie fortement sur la caractérisation des prix comme solutions d'équations aux dérivées partielles au sens classique ou au sens des solutions de viscosité. L'originalité de cet ouvrage réside aussi dans la présentation des techniques récentes de cible stochastique qui permettent d'étudier des modèles non classiques (comme ceux utilisés en trading haute fréquence) et de calculer des prix définis selon un critère de risque. Des notions essentielles en pratique comme la calibration, l'impact d'une erreur de spécification de modèle ou la capacité à mettre en place une couverture dynamique sont également abordées. Chaque chapitre est complété par une série d'exercices et d'exemples correspondant aux standards de l'industrie. Biographie de l'auteur

Bruno BOUCHARD est Professeur des Universités. Il enseigne actuellement à l'Université Paris-Dauphine et à l'ENSAE-ParisTech où il dirige le master recherche MASEF et la spécialité Finance de Marché de 3^e année, et à HEC. Il est l'auteur de nombreux articles en finance mathématique, et éditeur associé de la revue scientifique Finance and Stochastics. Jean-François CHASSAGNEUX est Docteur ès Sciences. Il a enseigné les mathématiques appliquées à la finance à l'Université Paris Diderot, à l'ENSAE-ParisTech et à l'Université d'Evry-Val d'Essonne. Il est actuellement Lecturer au sein du département de mathématiques de l'Imperial College London. Il est notamment spécialiste des méthodes d'évaluation non-linéaires en finance.

Download and Read Online Valorisation des produits dérivés Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX #AGPT94Y810S

Lire Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX pour ebook en ligne Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX
Téléchargement gratuit de PDF, livres audio, livres à lire, bons livres à lire, livres bon marché, bons livres, livres en ligne, livres en ligne, revues de livres epub, lecture de livres en ligne, livres à lire en ligne, bibliothèque en ligne, bons livres à lire, PDF Les meilleurs livres à lire, les meilleurs livres pour lire les livres Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX à lire en ligne. Online Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX ebook
Téléchargement PDF Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX Doc Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX Mobipocket Valorisation des produits dérivés par Bruno Bouchard, Jean-François CHASSAGNEUX EPub
AGPT94Y810SAGPT94Y810SAGPT94Y810S