



## **Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes**

 **Télécharger**

 **Lire En Ligne**

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

# Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes

*Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet*

**Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes** Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet

 [Télécharger Les outils stochastiques des marchés financiers u ...pdf](#)

 [Lire en ligne Les outils stochastiques des marchés financiers ...pdf](#)

## Téléchargez et lisez en ligne Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet

---

233 pages

Présentation de l'éditeur

Depuis 40 ans, les outils mathématiques probabilistes ont montré leur rôle central dans le développement d'outils d'aide à la décision pour les marchés financiers. Ils offrent un cadre méthodologique robuste de modélisation et calcul des risques associés aux produits dérivés, ces fameux instruments financiers qui dépendent de manière plus ou moins complexe d'autres produits financiers plus simples (actions, indices, taux de change, taux d'intérêt, matières premières). Cet ouvrage se veut être une introduction aux outils stochastiques de la finance de marché, et à leurs utilisations dans la gestion dynamique des produits dérivés. Pour le développement des outils probabilistes du calcul stochastique, nous suivons une approche élémentaire à la Föllmer, qui permettra à un lecteur ayant juste des bases de probabilité de rentrer plus facilement dans le sujet. Pour autant, cette grande simplification permet de traiter de manière complète des applications aux options (simples ou exotiques) sur actions, à la modélisation des taux d'intérêt ou du risque de crédit. A travers l'expérience de la crise financière actuelle, nous expliquons l'importance des hypothèses sous-tendant l'utilisation de ces outils en salle de marché. Biographie de l'auteur

Nicole El Karoui est professeur à l'Université Pierre et Marie Curie, après avoir été pendant dix ans professeur à l'Ecole Polytechnique. Spécialiste du contrôle stochastique, elle a orienté ses recherches depuis une vingtaine d'années autour des problèmes d'optimisation en finance. À l'Ecole Polytechnique, elle a créé l'équipe de recherche en mathématiques financières, qui a maintenant un rayonnement international, grâce notamment aux professeurs Gobet et Touzi et au soutien financier des banques via la Fondation du Risque et la Fédération des Banques Françaises. C'est par le biais du DEA de Probabilités et Finance, (Paris VI-Ecole Polytechnique) qu'elle a monté en 1990 avec Geman, qu'elle s'est fait connaître dans les marchés financiers du monde entier, allant jusqu'à faire la "une" du Wall Street Journal en 2006. Les "quant s" français sont très appréciés dans les banques d'investissement, même si parfois ils ont été accusés d'être à l'origine de la crise. Le présent ouvrage est une introduction aux outils de la finance de marché. Emmanuel Gobet est ancien élève de l'Ecole Polytechnique. Il a été successivement enseignant-chercheur à l'Université Pierre et Marie Curie, à l'Ecole Polytechnique, à Grenoble INP- Ensimag. Il est actuellement professeur de mathématiques appliquées à l'Ecole Polytechnique. Il est spécialiste des processus stochastiques notamment sur les problématiques de simulation, d'approximation ou d'estimation, en lien avec les applications notamment en finance. Par ailleurs, il a de multiples collaborations industrielles avec les établissements financiers, assurances ou énergéticiens.

Download and Read Online Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet #MB5V9TOS4PH

Lire Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet pour ebook en ligne Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet 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 Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet à lire en ligne. Online Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet ebook Téléchargement PDF Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet Doc Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet Mobipocket Les outils stochastiques des marchés financiers une visite guidée de Einstein a Black-Scholes par Nicole El Karoui, Emmanuel Gobet EPub

**MB5V9TOS4PHMB5V9TOS4PHMB5V9TOS4PH**