

Syllabus Mat4772A : Mathématiques financières

D. R. McDonald

September 5, 2018

- Matière du cours
Révision de l'espérance conditionnelle et une introduction aux martingales, temps d'arrêts et l'enveloppe de Snell. Taux d'intérêt et valeur actuelle, évaluation d'option en temps discret. Révision de la loi normale multivariée avec des applications la théorie du portefeuille de Markovitz. Une introduction au mouvement brownien et la formule Black-Scholes pour des options européennes.
- email : dmdsg@uottawa.ca
- lieu : LMX 223 - mardi 8:30-10:00, vendredi 10-11:30
- Heures de bureau : B07A 12:30-14:00 vendredi
- Évaluation : 5 devoirs 5% chaque
test misemestriel 25% la semaine après la semaine d'études
examen final 50%
- manuel du cours : Disponible sur Brightspace