

Modélisation mathématique en finance

Titulaire

Carolina LAURETI (Coordonnateur)

Mnémonique du cours

GEST-S497

Crédits ECTS

5 crédits

Langue(s) d'enseignement

Anglais

Période du cours

Deuxième quadrimestre

assets; provide a critical view of academic contributions on the topic

Références, bibliographie et lectures recommandées

Liste fournie au cours

Autres renseignements

Contact(s)

Ariane Szafarz, email

Méthode(s) d'évaluation

Autre

Méthode(s) d'évaluation (complément)

Examen oral, Travail individuel

Construction de la note (en ce compris, la pondération des notes partielles)

au terme de l'examen oral (y compris présentation du travail)

Programmes

Programmes proposant ce cours à la Solvay
Brussels School of Economics and Management

MA-INGE | Master en ingénieur de gestion | finalité Spécialisée/bloc
1

Contenu du cours

La matière peut changer chaque année. Actuellement, elle couvre le débat "marchés efficients versus finance comportementale"

Objectifs (et/ou acquis d'apprentissages spécifiques)

Le cours vise à approfondir la modélisation mathématique sur le comportement des agents et leur impact sur la formation des prix des produits et actifs financiers. Il offrira aussi un regard critique sur des contributions scientifiques du domaine couvert

Méthodes d'enseignement et activités d'apprentissages

Cours magistraux (présence obligatoire), Travaux (individuels)

Contribution au profil d'enseignement

Improve the understanding of theoretical models of agents' behaviors and their impact on the pricing of financial products and