



Séminaire des étudiants en mathématiques

CONFÉRENCIER: AZIZ RAYMOND ELMAHDAOUI

TITRE: **EDP en finance**

DATE: VENDREDI 11 NOVEMBRE 2011

HEURE: 12H30

SALLE: 6214

RÉSUMÉ:

Vous vous êtes toujours demandés comment on peut associer à un processus aléatoire une EDP? Non? Ce n'est pas grave! Venez quand même! On va parler du théorème de Feynman-Kac qui fait le lien entre les EDP et les espérances de processus. On va aussi discuter de la mesure neutre au risque et de son utilité en finance. Si vous êtes toujours réveillés après tout ça (et si le temps le permet) nous ferons même un peu d'algèbre! Intrigant, n'est-ce pas? Soyez-y!