

Sujet : Pricing des options via différents modèles discrets et continus

L'objectif de ce projet est d'évaluer les prix des options par différents modèles (Modèles discrets, Modèles stochastiques...) et dans ses différents styles (européennes, américaines, sans dividendes, avec dividendes...).

Travail demandé

- Modélisation numérique du modèle Cox Ross Rubinstein.
- Modélisation numérique du modèle de Black & Scholes.
- Vérifier la convergence du modèle CRR vers le modèle stochastique.

Rapport :

Le rapport doit contenir les parties suivantes :

- Modèles discrets : Cox-Ross Rubinstein.
- Modèles stochastiques : (modèle de black and scholes).
- Convergence de Cox-Rubinstein vers le modèle Black & Scholes.
- Partie numérique.

Code source.