

Modèle de Cox-Ross-Rubinstein

Bibliographie annotée

Alexis VO
Université Paris-Saclay

May 29, 2025

Cette bibliographie annotée présente les références que j'ai utilisé dans le cadre de mon stage au CMAP de l'Ecole polytechnique. Chaque référence est suivie d'une brève annotation qui résume son contenu et sa pertinence pour le sujet traité.

Renaud Bourles *Chapitre 9 - Le modèle de Cox-Ross-Rubinstein*. Mathematics for finance (2008-2010). 1st year Master Finance. Probabilités discrètes et modèles en temps discret. Disponible en ligne : [lien vers le chapitre](#).

- Evaluation des options dans un cadre discret puis continu.
- Application à l'évaluation des options européennes et américaines, call/put.
- Découverte du modèle à une et deux périodes.
- Stratégie de couverture et absence d'arbitrage.
- Généralisation à n périodes.

Bonne lecture introductive qui plonge instantanément dans le sujet.

Isabelle Bajeux *Gestion de portefeuille dans un modèle binomial*. Annale d'économie et de statistique, n°13, Jan-Mar 1989, p.49-76 (28 pages). Disponible en ligne (pour les membres de l'Univ. Paris-Saclay) : [lien vers l'article](#).

- Lecture en cours