

# Bibliographie

- [1] L. BACHELIER, *Théorie de la spéculation*, thèse, Annales scientifiques de l'école normale supérieure, Série 3, (17) : 21-86, janvier 1900.
- [2] P. BALDI, L. MAZLIAK P. PRIOURET, *Martingales et Chaînes de Markov : Théorie élémentaire et exercices corrigés*, Laboratoire de Mathématiques Raphaël Salem, Université de Rouen, Paris, Hermann, 2000.
- [3] T. BJÖRK, *Arbitrage theory in continuous time*, Oxford, Oxford university press, 2e édition, 2004.
- [4] F. BLACK, M. SCHOLES, *The pricing of options and corporate liabilities*, Journal of Political Economy, (81) : 637-654, May-June 1973.
- [5] J. BOISSONNADE, *Les options exotiques*, Paris, ESKA, 1997.
- [6] J. COX, A. ROSS M. RUBINSTEIN *Option pricing : a simplified approach*, Journal of Financial Economocs, vol 7, pp. 229-263, 1979.
- [7] J.C. COX, M. RUBINSTEIN *Options Markets*, Prentice-Hall, London, 1985.
- [8] J. DIXMIER, *L'intégrale de Lebesgue*, centre de documentation universitaire, Paris, 1962.
- [9] D. FOATA A. FUCHS, *Processus stochastiques Processus de Poisson, Chaînes de Markov et Martingales, Cours et exercices corrigés*, Dunod, Paris, 2002.
- [10] M. HAMMAD, *Introduction aux mathématiques financières, Polycopie*, Master SA 2ème Année, Semestre 3, Université Djillali Liabès de Sidi Bel Abbès, 2019-2020.
- [11] J.M. HARRISON, S. PLISKA, *Martingales and stochastic integrals in the theory of continuous trading, stochastic processus and their applications*, (11) : 215-260, 1981.
- [12] N. IKEDA and S. WATANABE, *Stochastic Differential Equations and Diffusion Processes*, North Holland, 1981.
- [13] J.JACOD et P.PROTTER, *L'essentiel en théorie des probabilités*, Vuibert, Paris, 2003.
- [14] J. JACOD and A. SHIRYAEV, *Limit Theorems for Stochastic Processes*, Springer, Verlag, New York, 1987.
- [15] M. JEANBLANC, *Cours de Calcul Stochastique*, Septembre 2002.
- [16] M. JEANBLANC, T. SIMON, *Elements de calcul stochastique*, Septembre 2005.

- [17] I. KARATZAS, S.E. SHREVE, *Brownien Motion and Stochastic Calcul*, Springer, 1988.
- [18] I. KARATZAS, and S.E SHREVE, *Methods of Mathematical Finance*, Springer, Verlag, New York (1998).
- [19] D. LAMBERTON, B. LAPEYER, *Introduction au Calcul Stochastique Appliqué à la Finance*, Ellipses, 2nd. ed.1997.
- [20] M. MINOUX, *Programmation mathématique*, 2 tomes. Dunod, 1983.
- [21] A.J. MORTON *Arbitrage and Martingales*, PhD thesis, Cornell University, 1989.
- [22] J. NEVEU, *Martingales à temps discret*, Masson, 1972.
- [23] R.S. LIPTSER and A. N. SHIRYAYEV, *Theory of Martingales*, Kluwer, Dordrecht, 1990.
- [24] B. OKSENDAL, *Stochastic Differential Equations*, Springer, 2005.
- [25] P.E. PROTTER, *Stochastic Integration and Differential Equations*, Springer, 1990,2nd. ed.2003.
- [26] E. ROMUALD, *Calcul stochastique appliqué à la finance*, ENSAE, Avril 2006.
- [27] N. ROUSSEAU, *Introduction au Calcul Stochastique Appliqué à la Finance*, Laboratoire Dieudonné, Université de Nice-Sophia Antipolis, January 29, 2007.
- [28] P. TANKOV, *Mathématiques financières*, Master 2 ISIFAR, édition 2013-2014.
- [29] N. TOUZI, *Martingales en temps discret et Chaînes de Markov*, Ecole Polytechnique, Département de Mathématiques Appliquées, Paris, Septembre 2009.
- [30] D. VILLEMONAIS, *Probabilités, Polycopie*, Première Année FICM, Semestre 2, École des Mines de Nancy, 2016-2017.