

Modélisation et détection de délit d'initié

Soutenance mi-parcours P3A

Heang Kitiyavirayuth, Lucas Broux

9 décembre 2017



1 Introduction

- Sujet choisi, problématique générale
- Objectifs du projet

2 Compréhension actuelle du problème

- Modélisation mathématique
- Jeu d'hypothèses
- Raisonnement

3 Simulations

4 Conclusion



Introduction

Sujet choisi

■ Modélisation et détection de délit d'initié.

Sujet choisi

- **Modélisation et détection de délit d'initié.**
- Problématique concrète mais actuellement assez mal résolue.

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.
 - 2 H. Föllmer, P. Imkeller, Anticipation cancelled by a Girsanov transformation : a paradox on Wiener space, Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist 29.4, 569-586, 1993.

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.
 - 2 H. Föllmer, P. Imkeller, Anticipation cancelled by a Girsanov transformation : a paradox on Wiener space, Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist 29.4, 569-586, 1993.
- Pour la suite du projet : à préciser :

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.
 - 2 H. Föllmer, P. Imkeller, Anticipation cancelled by a Girsanov transformation : a paradox on Wiener space, Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist 29.4, 569-586, 1993.
- Pour la suite du projet : à préciser :
 - Réalisation de simulations numériques.

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.
 - 2 H. Föllmer, P. Imkeller, Anticipation cancelled by a Girsanov transformation : a paradox on Wiener space, Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist 29.4, 569-586, 1993.
- Pour la suite du projet : à préciser :
 - Réalisation de simulations numériques.
 - Analyse théorique de cas particuliers.

Objectifs du projet

- Comprendre et analyser des articles sur le sujet :
 - 1 A. Grorud, M. Pontier, Insider trading in a continuous time market model, International Journal of Theoretical and Applied Finance, 1, p. 331-347, 1998.
 - 2 H. Föllmer, P. Imkeller, Anticipation cancelled by a Girsanov transformation : a paradox on Wiener space, Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist 29.4, 569-586, 1993.
- Pour la suite du projet : à préciser :
 - Réalisation de simulations numériques.
 - Analyse théorique de cas particuliers.
 - ...

Compréhension actuelle du problème



Simulations

Conclusion

Conclusion

