

SÉMINAIRE

Clarence Simard

Modèle général pour le carnet d'ordres limites

Résumé : La plupart des modèles de marché reposent sur l'hypothèse que les actions sont des actifs parfaitement liquide. En étudiant comment les actions sont transigées, nous verrons que cette hypothèse n'est pas respectée. Le premier objectif de la conférence sera donc de construire un modèle de marché représentant correctement le mécanisme de transaction des actions. Comme ce modèle repose sur des hypothèses différentes des modèles de marché classiques, nous allons ensuite étudier ce qu'il advient du premier théorème fondamental de l'évaluation dans ce nouveau contexte. Quelques rappels de la théorie de l'évaluation et du calcul stochastique seront aussi présentés.

Mardi 17 mars 2015, 15h00-16h00

PK-5333

Département de mathématiques, UQAM

Bienvenue à tous !