



Séminaire des étudiants en mathématiques

CONFÉRENCIER: CLARENCE SIMARD

TITRE: **Théorème d'absence d'arbitrage sous
l'hypothèse d'un marché illiquide**

DATE: VENDREDI 31 JANVIER 2014

HEURE: 12H30

SALLE: 5340

RÉSUMÉ:

La théorie classique de la finance mathématique suppose que le coût d'une transaction boursière correspond au prix unitaire multiplié par le nombre d'unité. Par exemple, le prix de 10 pommes est 10 fois le prix d'une pomme. Ça semble logique, mais, pour les actions, la réalité est bien différente. Après quelques explications sur le processus d'achat d'actions, nous allons construire un modèle mathématique qui représente mieux la réalité des transactions boursières et ensuite généraliser partiellement un des grands résultats des la finance mathématique à ce nouveau contexte.