



Séminaire des étudiants en mathématiques

CONFÉRENCIER: CLARENCE SIMARD

TITRE: **Théorie de la tarification et
théorème de Hahn-Banach**

DATE: VENDREDI 15 FÉVRIER 2013

HEURE: 12H30

SALLE: 5340

RÉSUMÉ:

Nous allons étudier quelques uns des résultats de la théorie de la tarification en absence d'arbitrage. Cette théorie démontre que l'on peut calculer le prix d'un droit conditionnel (produit dérivé) comme une espérance sous une certaine mesure au lieu de résoudre un problème d'optimisation. Nous aurons besoin au passage du théorème de Hahn-Banach.