

Evaluation et couverture d'options

Contexte

François Longin (ENPC 1990), professeur de finance à l'ESSEC, souhaite développer des logiciels d'évaluation et de couverture d'options (options standards et exotiques).

Description du travail

Le travail du stagiaire pourra suivre les étapes suivantes :

- 1) Etude des modèles d'évaluation et de couverture d'options (revue de la littérature scientifique)
- 2) Etude des méthodes numériques d'évaluation et de couverture d'options (formules fermées, différences finies, simulation de Monte Carlo, etc.)
- 3) Programmation et tests des modèles (utilisation de modules existants personnels et open source de type « quantlib »)
- 4) Intégration sur le site internet www.longin.fr
- 5) Rédaction du rapport de stage

Profil de candidat recherché

Le candidat devra maîtriser les bases de la théorie des probabilités, les méthodes numériques classiques et des techniques de programmation (Excel/C/C++) et les langages internet (html/php). Les qualités demandées pour ce stage sont la rigueur et le sérieux. En outre, le candidat devra faire preuve d'une grande autonomie dans son travail.

Divers

Durée : 3 mois / Lieu : ESSEC (Cergy-Pontoise) / Bureau et ordinateur à disposition.

Pour me contacter pour ce stage :

Merci de m'envoyer par e-mail à longin@essec.fr une lettre de motivation et un CV détaillant vos compétences mathématiques et informatiques.