

1. Record Nr.	UNINA9910734995203321
Autore	Racicot Francois-Eric
Titolo	Le calcul numérique en finance empirique et quantitative [[electronic resource] ] : Ingénierie financière et Excel (Visual Basic), 2e édition // Francois-Eric Racicot, Raymond Theoret
Pubbl/distr/stampa	Quebec : , : Presses de l'Universite du Quebec, , 2004
ISBN	2-7605-1772-1 1-4356-9050-8
Edizione	[2nd ed.]
Descrizione fisica	1 online resource (822 p.)
Altri autori (Persone)	TheoretRaymond
Disciplina	332.64/57
Soggetti	Financial engineering Derivative securities - Prices - Mathematical models Electronic books.
Lingua di pubblicazione	Francese
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Note generali	Description based upon print version of record.
Nota di bibliografia	Includes bibliographical references.
Nota di contenuto	TABLE DES MATIERES; AVANT-PROPOS; PRESENTATION DE LA DEUXIEME EDITION; Partie 1: LES FONDEMENTS; Chapitre 1: LES FONDEMENTS DU CALCUL NUMERIQUE; Chapitre 2: UNE INTRODUCTION AUX METHODES; Partie 2: «BOOTSTRAPPING» ET ALGORITHMES D'OPTIMISATION; Chapitre 3: LES ASPECTS THEORIQUES; Chapitre 4: LES ASPECTS THEORIQUES DE LA CONSTRUCTION DE L'ARBRE BINOMIAL DE TAUX D'INTERET DU MODELE DE BLACK, DERMAN ET TOY; Chapitre 5: VARIATIONS SUR LES ASPECTS THEORIQUES DE LA VaR AVEC APPLICATIONS VISUAL BASIC DU CALCUL DE LA VaR SELON LA METHODE DU BOOTSTRAPPING ET SELON L'EXPANSION DE CORNISH-FISHER Partie 3: ARBRES BINOMIAUX ET TRINOMIAUX ET SIMULATION MONTE CARLO Chapitre 6: VARIATIONS SUR LES ASPECTS THEORIQUES ET PRATIQUES D'OPTIMISATION; Chapitre 7: DE LA CONSTRUCTION D'ARBRES BINOMIAUX ET TRINOMIAUX DES PRIX DES PRODUITS DERIVES ET DE SES RAPPORTS AVEC LA SIMULATION MONTE CARLO; Chapitre 8: ARBRES BINOMIAUX ADDITIFS ET MULTIPLICATIFS POUR EVALUER LES OPTIONS AMERICAINES CLASSIQUES SUR ACTIONS PORTANT DIVIDENDE; Partie 4: QUELQUES APPLICATIONS

Chapitre 9: DES ARBRES BINOMIAUX DE TAUX D'INTERET DES MODELES DE BLACK, DERMAN ET TOY ET DE HO ET LEE A L'EVALUATION D'OPTIONS SUR TAUX D'INTERET DANS LE CADRE DE LA PROGRAMMATION VISUAL BASIC; Chapitre 10: MODELISATION DE LA VALEUR; Chapitre 11: LE TAUX REPO IMPLICITE ET LES STRATEGIES D'ARBITRAGE SUR LE MARCHE A TERME; Partie 5: METHODES MODERNES DE LA FINANCE EMPIRIQUE ET QUANTITATIVE; Chapitre 12: LES OPTIONS REELLES; Chapitre 13: LA METHODE DES DIFFERENCES FINIES; Chapitre 14: L'ANALYSE DES DONNEES A HAUTE FREQUENCE; Chapitre 15: LE TRAITEMENT ECONOMETRIQUE DES ERREURS SUR LES VARIABLES PAR LES VARIABLES INSTRUMENTALES; Annexe 1: INTRODUCTION A L'ECONOMETRIE FINANCIERE; Annexe 2: METHODE GENERALE POUR CALCULER UNE FRONTIERE EFFICIENTE AVEC APPLICATION VISUAL BASIC; Annexe 3: EVALUATION DE LA GESTION DE PORTEFEUILLE; Annexe 4: TECHNIQUES D'ASSURANCE DE PORTEFEUILLES; Annexe 5: PROGRAMME VISUAL BASIC D'UNE MATRICE DE CORRELATION ET DE VARIANCE-COVARIANCE DES RENDEMENTS DES TITRES D'UN PORTEFEUILLE; Annexe 6: FRONTIERES EFFICIENTES INSPIREES DE BENNINGA (2000) ET DE JACKSON ET STAUNTON (2001); Annexe 7: DISTINCTION ENTRE L'APPROCHE DU PORTEFEUILLE DUPLIQUANT ET L'APPROCHE RISQUE-NEUTRE A LA CONSTRUCTION DE L'ARBRE BINOMIAL

---

### Sommario/riassunto

Les auteurs presentent dans cette deuxieme edition un expose rigoureux sur la determination des prix des options, tant sur les actions que sur les taux d'interet, et traitent plus particulierement des options reelles de plus en plus utilisees pour evaluer les projets d'investissement. Un nouveau chapitre, tres etoffe, sur la theorie de l'ingenierie financiere a ete ajoute, de meme que deux autres sur l'analyse des donnees a haute frequence et sur les erreurs liees aux variables financieres. Divers programmes inedits en Visual Basic (Excel) completent cet ouvrage.

---