

Le monde de la finance présente plusieurs phénomènes incontrôlables, en particulier l'investissement dans de grands projets. Ce qui a fait l'objet principal de notre recherche par l'étude d'un modèle financier exprimé à l'aide d'une équation différentielle stochastique du type Itô. La règle de décision effectuée dans ce travail est un outil indispensable que l'investisseur utilisera pour décider de continuer ou d'abandonner son projet d'investissement.

La simulation élaborée sur ce modèle, permet d'en sortir avec plein de renseignements et d'informations sur l'analyse mathématique et statistique du taux d'investissement. Et cela par l'étude des courbes du taux, de l'investissement productif.

Par ailleurs, nous avons vu comment la simulation aboutissait à l'étude statistique des premiers instants de passage relatif au modèle étudié. Cette simulation nous a permis d'estimer une densité empirique pour ces temps aléatoires, dont l'importance est l'utilité sont non des moindres pour les acteurs financiers.

Pour conclure, nous dirons que la simulation, a permis d'appliquer la théorie de façon concrète, et par conséquent, de mieux maîtriser l'usage qu'on peut faire de l'informatique dans les questions propre a l'investissement dans le monde de la finance.