

Résumé

Dans cette thèse, nous considérons l'estimation des paramètres des équations différentielles stochastiques utilisant deux modèles d'évaluation d'options qui sont le modèle de Black-Scholes et le modèle à sauts de Merton.

Pour ces deux modèles, nous présentons une nouvelle méthode basée sur les temps de passage par une borne donnée. Nous comparons notre méthode aux autres méthodes d'estimation. Nous illustrons cette méthode par l'application sur des données réelles de cours de l'action de l'or de Londres.

Mots clés

Paramètres, équations différentielles stochastiques, modèle de Black-Scholes, modèle à sauts de Merton, temps de passage, volatilité stochastique.