

# Répartition des élèves par projets.

Tony Lelièvre et Olivier Bokanowski

7 février 2012

Un rapport succinct devra être rédigé résumant le problème, l'approche étudiée et les résultats numériques obtenus. Les programmes et le rapport devront être envoyés par mël, ([boka@math.jussieu.fr](mailto:boka@math.jussieu.fr), [lelievre@cermics.enpc.fr](mailto:lelievre@cermics.enpc.fr)) et deux exemplaires du rapport devront être remis à Tony Lelièvre (CERMICS). Les résultats seront également présentés lors d'une soutenance orale au cours de laquelle chacun des étudiants du groupe prendra la parole.

Il faudra rendre les rapports et les programmes au plus tard le **mardi 7 février**. Les soutenances auront lieu dans la semaine du 6 février.

B. Bellahsain et A. Belykh	Projet 8 : Pricing d'options avec volatilité stochastique
Y. Chen et J. Lin	Projet 8 : Pricing d'options avec volatilité stochastique
A. Ameziane et B. Sbai	Projet 2 : Calcul de grecques
L. Siegelman et M. Barut	Projet 7 : Options américano-asiatiques
M. Sene et N. Saba	Projet 2 : Calcul de grecques
L. Rugama et M. Mitjavile	Projet 6 : Différences finies pour deux actifs
E. Villaume et S. Hagège	Projet 1 : Options asiatiques
T.-M. Boussahoua et I. Bouzelfen	Projet 5 : Optimisation de portefeuille
M. Idaroussi	Projet 4 : Options avec sauts
R. Zerbib et L. Hacq	Projet 7 : Options américano-asiatiques
A. Chafai-Zizi	Projet 1 : Options asiatiques

Dès que vous avez pris connaissance du sujet, vous devez contacter l'enseignant responsable du projet le plus rapidement possible pour récupérer les documents bibliographiques.