
ALEXANDRE SCOTT, University of Quebec in Montreal

Un temps d'arrêt dans le temps pour des portefeuilles moyenne-variance sans faillite

Dans cet exposé, nous évaluerons la probabilité d'atteindre une richesse actualisée visée basée sur un temps d'arrêt introduit par Li et Zhou (2006) et appliquée à des stratégies moyenne-variance avec interdiction de faillite. À cet effet, nous utiliserons les résultats sur le premier temps de passage des processus de Gauss-Markov à travers des frontières dépendantes du temps.