

Monique Jeanblanc
Département de mathématiques
Université d'Evry-Val-d'Essonne

Le cours portera sur le grossissement de filtrations. Il s'agit de répondre aux questions suivantes: soit deux filtrations \mathbb{F} et \mathbb{G} telles que \mathbb{F} soit contenue dans \mathbb{G} . Que peut on dire des \mathbb{F} martingales? On étudiera le cas où ce sont des \mathbb{G} martingales puis le cas où ce sont des \mathbb{G} -semi martingales. Dans le second cas, on donnera leur décomposition en tant que \mathbb{G} -semi-martingales

1. Immersion: cas où les \mathbb{F} martingales sont des \mathbb{G} martingales
2. Grossissement initial : $\mathbb{G} = \mathbb{F} \vee \sigma(L)$ où L est une variable aléatoire
3. Grossissement progressif : $\mathcal{G}_t = \mathcal{G}_t \vee \sigma(\tau \vee t)$ où τ est une variable aléatoire positive. On regardera le cas de temps honnêtes et de temps initiaux
4. Si le temps le permet: application au délit d'initié et au risque de crédit