

PRÉFACE

Ce volume contient le texte d'une seule série de conférences données lors des journées annuelles organisées par le Centre de Mathématiques de l'Ecole Polytechnique au mois de mai 1992.

Le thème en était « Processus aléatoires de diffusion et modélisation de problèmes financiers ». Il s'agissait d'introduire pour les professeurs de Classes Préparatoires quelques rudiments de mathématiques financières, précédées d'une introduction aux processus stochastiques. Les conférences de J. Neveu n'ont pas été rédigées.

Le texte des conférences N. El Karoui (rédigé en collaboration avec L. Elie) semblera difficile à qui ne possède pas les notions élémentaires de calcul stochastique, et nécessite donc, pour être compris, une connaissance préliminaire dans ce domaine.

Nicole Berline et Claude Sabbah

