

Introduction to finance

ECTS:4

Volume horaire: 39

Description du contenu de l'enseignement :

- 1. Présentation des marchés financiers et produits dérivés.
- 2. Taux d'intérêt simples et composés.
- 3. Calcul actuariel, choix d'investissement, notion de taux de rentabilité interne.
- 4. Notion d'arbitrage et de prix d'arbitrage. Application aux obligations.
- 5. Produits dérivés 1 : contrats à terme, swaps.
- 6. Produits dérivés 2 : options européennes ; modèle binomial pour le calcul du prix d'arbitrage d'une option européenne ; extension au cas d'une option américaine.

Compétence à acquérir :

Culture générale en finance et finance internationale.

Présenter les concepts de base et les opérations classiques en finance faisant intervenir une réallocation des liquidités d'une période à l'autre.

Présenter le marché des changes et les techniques de base associées à la gestion du risque de change.

Présenter les marchés de produits dérivés : descriptions de contrats, des intervenants et du fonctionnement.

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16 - 04/11/2025