Produits dérivés

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

- Produits dérivés de la finance de marché.
- Présenter le fonctionnement des produits dérivés (forwards, futures, swaps et options), dans un but de gestion optimale de divers risques (taux, intérêt, change, volatilité, ...).

Chapter 1: Introduction to risk management and derivatives instruments

Chapter 2: Mechanics of Futures Markets

Chapter 3: Determination of Forward and Futures Prices

Chapter 4: Hedging Strategies Using Futures

Chapter 5: Interest Rates

Chapter 6: Interest Rate Futures

Chapter 7: Swaps

Chapter 8: Mechanics of Options Markets

Chapter 9: Properties of Stock Options

Chapter 10: Trading Strategies Involving Options

Chapter 11: Credit Derivatives

Compétence à acquérir :

L'étudiant acquiert de solide connaissance théorique sur les mécanismes sous-jacents au fonctionnement des produits dérivés.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen final

Bibliographie, lectures recommandées :

John C. Hull, “Options, Futures, and Other Derivatives”, Pearson ed., 2018