

Fixed income et produits dérivés

**ECTS : 6**

**Description du contenu de l'enseignement :**

Pricing et utilisation de produits dérivés: contrats à terme, swaps et options (temps discret, temps continu)

**Compétence à acquérir :**

pricing de produits dérivés

**Mode de contrôle des connaissances :**

partiel de 2h

**Bibliographie, lectures recommandées :**

Futures, Options and Other Derivatives - John Hull

**Document susceptible de mise à jour - 17/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16**