Produits dérivés

ECTS : 3

Enseignant responsable : Jerome MATHIS (https://www.jeromemathis.fr/aio)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

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

Compétences 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

Coefficient : 2.00

Bibliographie, lectures recommandées :

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

Document susceptible de mise à jour - 04/11/2026

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