Fixed income et produits dérivés

ECTS : 6

Langue du cours : Français

Volume horaire : 70

Description du contenu de l'enseignement :

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

Compétences à acquérir :

pricing de produits dérivés

Mode de contrôle des connaissances :

partiel de 2h

Coefficient : 2.00

Bibliographie, lectures recommandées :

Futures, Options and Other Derivatives - John Hull

Document susceptible de mise à jour - 04/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16