Instrument et marchés dérivés

ECTS : 6

Description du contenu de l'enseignement :

- Introduction aux produits dérivés

- Caractéristiques et évaluation des contrats futures et forward

- La gestion des risques avec des contrats futures

- Caractéristiques et évaluation des options

- La gestion des risques avec les instruments du marché de gré à gré

- Risque de taux d'intérêt: définition et gestion

- Risque de crédit: définition et gestion

Compétence à acquérir :

- Comprendre, sur la base d'exemples concrets (matières premières, taux d'intérêt, actions,…), le fonctionnement des marchés dérivés et leur organisation (marchés de gré à gré / marchés organisés).

- Expliquer l'utilisation qui peut être faite des principaux instruments dérivés tels que les contrats à terme, les options et les swaps.

- Maîtriser les bases de l'évaluation de ces instruments.

Mode de contrôle des connaissances :

Contrôle continu 50%

Examen terminal 50%

Bibliographie, lectures recommandées :

Hull J.C. "Options, futures and other derivatives". Polycopié associé au cours.

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16