Dérivés énergétiques

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

[Marché électricité - Gestion des risques - Produits dérivés - Modèles de prix]

Après un rappel du fonctionnement et de la formation des prix sur les marchés d'électricité infra journalier, journalier et à terme, ce cours vise à manipuler les outils financiers utilisés par les gérants d'actifs pour couvrir leur parc (modélisation de portefeuilles avec les bons produits dérivés, stratégies de couverture ...), et à étudier différentes classes de modèles pour simuler des prix de commodités (financier, statistique, par fondamentaux). Ce cours est quantitatif et centré sur les marchés d'électricité.

Compétence à acquérir :

Compétences en finance de marchés de l'énergie

Mode de contrôle des connaissances :

Projet de modélisation des prix spot électricité France

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