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 - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16