

5.0 crédits

30.0 h

2q

Enseignants:	Platten Isabelle ;
Langue d'enseignement:	Français
Lieu du cours	Mons
Préalables :	MGEST2109 - Finance d'entreprise
Thèmes abordés :	<ol style="list-style-type: none"> 1. Les marchés des futures 2. La couverture avec les futures 3. La détermination des prix à terme 4. Les futures de taux 5. Les swaps 6. Les propriétés des options et les stratégies de base en options 7. L'évaluation des options en temps discret et en temps continu 8. Les stocks options, les options sur devises, sur indices, sur futures 9. La gestion des positions en option 10. La volatilité
Acquis d'apprentissage	<p>Au terme de ce cours, l'étudiant aura une connaissance du fonctionnement des contrats à terme, des swaps et des options, de la façon dont ces contrats sont utilisés dans la couverture des risques et de leur évaluation.</p> <p><i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i></p>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	<ul style="list-style-type: none"> ' Examen écrit ' Evaluation continue
Méthodes d'enseignement :	<ul style="list-style-type: none"> ' Cours magistral ' Applications sous Excel
Bibliographie :	HULL J. (2009), Options, Futures and Other Derivatives, 7th ed., Pearson.
Cycle et année d'étude :	<ul style="list-style-type: none"> > Master [120] en ingénieur de gestion > Master [120] en sciences de gestion > Master [120] en sciences de gestion > Master [120] en ingénieur de gestion
Faculté ou entité en charge:	BLSM