





5 crédits	30.0 h	Q1
-----------	--------	----

Enseignants	Platten Isabelle ;
Langue d'enseignement	Français
Lieu du cours	Mons
Préalables	MGEST1219 FINANCE
Thèmes abordés	<p>Ce cours apporte aux étudiants un cadre :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Pour comprendre les concepts fondamentaux ayant trait aux produits dérivés (forward et futures, swaps, options) ; - Pour développer les compétences nécessaires à l'évaluation des produits dérivés (processus de Ito, évaluation risque neutre) ; - Pour comprendre un éventail de problématiques liées à la gestion des risques et à la décision d'investissement utilisant les actifs dérivés
Acquis d'apprentissage	<p>A la fin de ce cours, les étudiants seront capable de :</p> <ul style="list-style-type: none"> - Décrire les principales caractéristiques de produits dérivés de bases, tels les contrats forward, futures, swaps et les options. - D'appliquer le principe d'évaluation risque neutre pour évaluer les dérivés dans un marché efficients ; - De calculer le prix des produits dérivés, par des modèles mathématiques ou par des méthodes numériques ; - De mettre en place de stratégie de gestion et de couverture des risques qui font appels à ces produits dérivés. <p>-----</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 (80%) • Contrôle continue (20%) • <u>La note du contrôle continu est définitivement acquise</u>
Méthodes d'enseignement	Cours magistral, classe inversée, exercices et études de cas
Contenu	<ul style="list-style-type: none"> - Caractéristiques des produits dérivés, tels les contrats forward, futures, swaps et les options. - Principe d'évaluation risque neutre pour évaluer les dérivés dans un marché efficients ; - Calcul du prix des produits dérivés, par des modèles mathématiques ou par des méthodes numériques ; - Mise en place de stratégie de gestion et de couverture des risques qui font appels à ces produits dérivés.
Ressources en ligne	Student corner

Bibliographie	Hull, Options, Futures, and Other Derivatives (10th Edition), Pearson, 2017
Faculté ou entité en charge:	CLSM

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [60] en sciences de gestion	GESM2M1	5		
Master [120] en ingénieur de gestion	INGM2M	5		
Master [120] en sciences de gestion	GEST2M	5		
Master [120] en sciences de gestion	GESM2M	5		
Master [120] en ingénieur de gestion	INGE2M	5		