

En raison de la crise du COVID-19, les informations ci-dessous sont susceptibles d'être modifiées, notamment celles qui concernent le mode d'enseignement (en présentiel, en distanciel ou sous un format comodal ou hybride).





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

Enseignants	Platten Isabelle ;
Langue d'enseignement	Français
Lieu du cours	Mons
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	<p>En raison de la crise du COVID-19, les informations de cette rubrique sont particulièrement susceptibles d'être modifiées.</p> <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	<p>En raison de la crise du COVID-19, les informations de cette rubrique sont particulièrement susceptibles d'être modifiées.</p> <p>Cours magistral, classe inversée, exercices et études de cas</p>
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

Force majeure

Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Si les conditions sanitaires le permettent, l'examen écrit aura lieu en présentiel. Si l'examen ne peut être organisé en présentiel, un examen à distance sera organisée dans Student Corner le matin (9h-11h), suivi d'un oral dans Teams à partir de 12h (10 minutes par étudiant)
---	--

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