

| | | |
|--------------|--------|----|
| 5.00 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 cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de :</p> <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. 1 • 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. |
| Modes d'évaluation des acquis des étudiants | <ul style="list-style-type: none"> • Examen écrit (questions ouvertes) |
| 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 [120] en sciences de gestion | GESM2M | 5 | |  |
| Master [60] en sciences de gestion | GESM2M1 | 5 | |  |
| Master [120] en gestion de l'entreprise | GENT2M | 5 | |  |
| Master [120] : ingénieur de gestion | INGE2M | 5 | |  |
| Master [120] en sciences de gestion | GEST2M | 5 | |  |
| Master [120] : ingénieur de gestion | INGM2M | 5 | |  |