






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		