
Finance de Marché

ETCS : 5 ECTS

Nombre d'Heures : CM : 86h

Responsable : Anne-Marie Hugues

Intervenants : Frank Ciosi, Didier Faivre, Octave Jokung, Elisa Luciano

Ce cours de Finance regroupe plusieurs parties. Il s'agit de donner aux étudiants un aperçu de toutes les facettes de la finance de marché sur lesquelles ils seront amenés à travailler dans leur future vie professionnelle d'informaticien pour la finance. Le cours vise donc des objectifs multiples :

- Donner une vue générale des marchés financiers et de leur fonctionnement.
Poser les bases de la théorie du risque et l'illustrer par des cas concrets d'arbitrage en gestion de portefeuille.

Poser les bases du calcul actuariel.

- Définir les actifs dérivés et approfondir leurs stratégies de gestion.
Comprendre le lien entre les ajustements de convexité et les ajustements quanto dans les produits dérivés et le coût du hedge pour les traders qui managent les produits. Application aux CMS, Libor in arrears, forward quanto. Comprendre d'autres effets de convexité sur les taux (ex : futures vs forwards)