

Table des matières

Chapitre 1	Introduction.....	5
Chapitre 2	Le fonctionnement des marchés de futures	14
Chapitre 3	Les stratégies de couverture par les contrats futures	19
Chapitre 4	Les marchés de taux d'intérêt	25
Chapitre 5	La détermination des prix forward et des prix futures	32
Chapitre 6	Les futures de taux d'intérêt	40
Chapitre 7	Les swaps	47
Chapitre 8	Titrisation et crise financière de 2007.....	55
Chapitre 9	Les XVA.....	58
Chapitre 10	Le fonctionnement des marchés d'options.....	60
Chapitre 11	Les propriétés des options sur actions.....	68
Chapitre 12	Les stratégies d'échanges	75
Chapitre 13	Les arbres binomiaux.....	84
Chapitre 14	Processus de Wiener et lemme d'Itô.....	97
Chapitre 15	Le modèle de Black, Scholes et Merton.....	104
Chapitre 16	Les stock-options	118
Chapitre 17	Les options sur indices et devises.....	122
Chapitre 18	Les options sur contrats futures	133
Chapitre 19	Les lettres grecques	141

4 Options, futures et autres actifs dérivés

Chapitre 20	Les courbes de volatilité	155
Chapitre 21	Les procédures numériques	163
Chapitre 22	Value at Risk et expected shortfall	182
Chapitre 23	L'estimation des volatilités et des corrélations	188
Chapitre 24	Le risque de crédit	194
Chapitre 25	Les dérivés de crédit	202
Chapitre 26	Les options exotiques	210
Chapitre 27	Modèles et méthodes numériques avancés	220
Chapitre 28	Martingales, changements de mesure et de numéraire	232
Chapitre 29	Les dérivés de taux : les modèles de marché standard	239
Chapitre 30	Ajustements de convexité, ajustements temporels et quantos	246
Chapitre 31	Les dérivés de taux : la modélisation du taux court	253
Chapitre 32	Les modèles de taux court fondés sur l'absence d'arbitrage	259
Chapitre 33	La modélisation des taux forward	265
Chapitre 34	Retour sur les swaps	271
Chapitre 35	Les dérivés climatiques, d'énergie et d'assurance	273
Chapitre 36	Les options réelles	276