



FINANCE DE MARCHÉ

MARKET FINANCE

Responsable(s): **Christian DE PERETTI**

| Cours : 16.0 | TD : 12.0 | TP : 0.0 | Autonomie : 4.0 | BE : 0.0 | Projet : 0.0 | Langue du cours : FR

Objectifs de la formation

L'objectif de ce cours est de donner un condensé des connaissances nécessaires pour pratiquer la finance des marchés de capitaux et des produits dérivés.

Ce module permettra également de faciliter le suivi de certaines options financières IM en 3e année et du Master SAFIR (Sciences actuarielle et financière et Ingénierie des Risques).

Le cours développera les bases de l'évaluation et de la gestion des actifs et des produits dérivés.

Mots-clés : évaluation d'actifs, gestion de portefeuilles, produits financiers dérivés.

Programme

- Partie I : Introduction a la finance des marchés de capitaux
 - o Chap. 1 : La Valeur Du Temps
 - o Chap. 2 : Le Marché Monétaire
 - o Chap. 3 : Les Obligations
 - o Chap. 4 : Les Actions
 - o Chap. 5 : Les Produits Dérivés
 - o Chap. 6 : L'éthique en finance, les fonds vertueux, les fonds du "vice"
- Partie II : Gestion de portefeuilles actions-obligations

Compétences

- Compétences méthodologiques pour professionnels de la finance.

Travail en autonomie

Objectifs : Cette activité n'est pas concernée par des activités d'autonomie cadrées en dehors du travail personnel.

Méthodes : Cette activité n'est pas concernée par des activités d'autonomie cadrées en dehors du travail personnel.

Bibliographie

Edwin J. Elton, Martin J. Gruber, Stephen J. Brown, William N. Goetzmann, *MODERN PORTFOLIO THEORY AND INVESTMENT ANALYSIS*, Wiley, 2014
J.C. Hull *OPTIONS, FUTURES, AND OTHER DERIVATIVES*, Times Books, 2011
M.W. Baxter and A.J.O. Rennie *FINANCIAL CALCULUS*, Cambridge University Press, 1996

Contrôle des connaissances

- Examen intermédiaire écrit d'une heure (pendant les heures de cours) vers la moitié de l'action de formation.
- Examen final écrit de deux heures sous forme d'exercices.