

Marchés Financiers

ECTS : 3

Volume horaire : 30

Description du contenu de l'enseignement :

Connaissance générale des marchés de capitaux (fonctionnement et raison d'être). Mathématiques des calculs financiers. Initiation à la modélisation stochastique des marchés et principaux résultats de la théorie "classique".

Financement, risques et marchés de capitaux (actions, obligations, option, marché monétaire, ...) Calculs actuariels classiques (taux, capitalisation, actualisation, duration, sensibilité, immunisation de portefeuille, ...) Modélisation stochastique simplifiée du marché action (volatilité, "beta", corrélations, diversification, théorie du "MEDAF" et principaux résultats, ...) Analyse critique des modélisations théoriques

Bibliographie, lectures recommandées :

Marchés financiers, gestion de portefeuille et des risques, Jacquillat B., Solnik B., 4^e d., Dunod, 2004 Financial Economics, Bodie Z., Merton R., 2th ed., Prentice Hall, 2007 An introduction to derivatives & Risk management, Chance D., Brooks R., 7th ed., Thomson South- Western, 2007

Mathématiques des marchés financiers, Dalbarade J.M., 3^e d., Eska, 2005

Bourse et marchés financiers, Fleuriet M., Simon Y., 2^e d., Economica, 2003

Financial Institutions and Markets, Madura J., 7th ed., Thomson South-Western, 2006

Financial markets and Institutions, Mishkin F., Eakins S., 5^e d., Addison Wesley, 2006 Corporate finance, Ross S.,

Westerfield R., Jaffe J., 7^e d., Mc Graw Hill, 2005

Encyclopédie des marchés financiers, Simon Y. (sous la direction de), Economica, 1997 Finance d'entreprise, Vernimmen P., 6^e d., Dalloz, 2005

Document susceptible de mise à jour - 08/02/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16