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 marche´s 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 :

Marche´s financiers, gestion de portefeuille et des risques, Jacquillat B., Solnik B., 4ee´d., Dunod, 2004 Financial Economics, Bodie Z., Merton R., 2thed., Prentice Hall, 2007 An introduction to derivatives & Risk management, Chance D., Brooks R., 7thed., Thomson South- Western, 2007
Mathe´matiques des marche´s financiers, Dalbarade J.M., 3ee´d., Eska, 2005
Bourse et marche´s financiers, Fleuriet M., Simon Y., 2ee´d., Economica, 2003
Financial Institutions and Markets, Madura J., 7thed., Thomson South-Western, 2006
Financial markets and Institutions, Mishkin F., Eakins S., 5ee´d., Addison Wesley, 2006 Corporate finance, Ross S., Westerfield R., Jaffe J., 7ee´d., Mc Graw Hill, 2005
Encyclope´die des marche´s financiers, Simon Y. (sous la direction de), Economica, 1997 Finance d'entreprise, Vernimmen P., 6ee´d., Dalloz, 2005