

Private Equity - Ingénierie financière

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Enseignement / Thèmes abordés

- Thème 1 : la décision d'investissement
- Thème 2 : la diversification : du portefeuille à 2 titres au portefeuille à 'n' titres
- Thème 3 : Allocation d'actifs : les frontières efficientes
- Thème 4 : Le Modèle d'Equilibre Des Actifs Financiers
- Thème 5 : La Politique Financière de l'entreprise
- Thème 5 : La Politique d'endettement et la structure du capital
- Thème 6 : Interaction entre décision d'investissement et décision de financement

Compétence à acquérir :

- - Compétence 1 : être capable de mesurer les attentes en termes de rentabilité et de risque d'un portefeuille
- - Compétence 2 : être capable d'identifier la sur ou sous-évaluation d'un portefeuille d'actifs risqués
- - Compétence 3 : être capable de comprendre la structure du capital d'une entreprise et du coût de ses sources de financement

Mode de contrôle des connaissances :

- . Correction d'exercices à présenter en classe
- . Notes de participation et examen final

Bibliographie, lectures recommandées :

Alphonse, P., Desmuliers, G., Grandin, P. et M. Levasseur (2017), *"Gestion de portefeuille et marchés financiers"*, 2ème édition, Pearson.

Bodie, Z. et R. Merton (2011), *"Finance"*, Adapté par C. Thibierge, 3e éd., Pearson

Bodson, L., Grandin, P., Hübner, G. et M. Lambert (2010), *"Performance de portefeuille"*, 2e éd., Pearson Education.

Brealey, R.A, Myers, S.C. et F. Allen (2014), *"Principles of Corporate Finance"*, 11th Global Edition, Mc Graw Hill Education.

Cobbaut, R., Gillet, R. et G. Hübner, (2015), *"La gestion de portefeuille ; Instruments, stratégie et performance"*, 2e Edition, De Boeck Supérieur.

Farber, A., Laurent, M., Oosterlinck, K. et H. Pirotte (2011), *"Finance"*, 3e éd., Pearson.

Goffin, R., (2012), *"Principes de Finance Moderne"*, 6e éd., Collection Gestion, Série : Politique générale, Finance et Marketing, Ed. Economica.

Hamon, J. (2014), *"Bourse et gestion de portefeuille"*, 5ème édition, Economica.

Vernimmen, P., Quiry, P. et Y. Le Fur, (2020), *"Finance d'entreprise 2021"*, 19e éd., Dalloz

Document susceptible de mise à jour - 18/02/2026

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