

## 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 efficaces
- 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., Desmulliers, 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