

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 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 - 02/04/2026**

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