Gestion des risques financiers

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Plan du cours : 1. Métiers et enjeux de la Trésorerie (2h00)-La trésorerie: interface avec les banques-Les métiers de la trésorerie-Gestion des partenaires bancaires-Prévisions de trésorerie-La gestion des risques-Rappels sur les instruments financiers **2.** Risque de liquidité et financements (3h30)-Le risque de liquidité-Les différents types de financements-Le court terme-Le financement bancaire-Le financement obligataire-Les financements «verts»-Les placements de trésorerie **3.** Risque de taux (3h30)-Le risque de taux d'intérêt -Revue des taux de référence-Le swap de taux-Cash flow hedge et fair value hedge-Les cross currency swaps-Caps et floors-Les swaptions-Identification des risques et politique de couverture **4.** Risque de change (3h30)-Identification du risque de change-Forwardet swap-Les options-Valorisation-Comptabilisation-Politique de couverture **5.** Risque matière première (3h30)-Identification des risques matières premières-Spécificité de la gestion des commodities-Futures, forwardset swaps-Les options-Comptabilisation-Politique de couverture-Etude de caS **6.** Conclusion et cas pratiques (2h00)

Compétence à acquérir :

Apprendre à identifier, évaluer et gérer les risques financiers de l'entreprise. Anticiper les besoins de liquidité, structurer ses financements et adopter les couvertures de taux appropriées. Définir une politique de couverture du risque de change et du risque matière première. Identifier à travers la communication d'une entreprise ses risques et sa politique de couverture.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen final 100% - écrit 3h

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026

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