

# Méthodes et instruments de la finance

Session 2 : évaluation écrite

## Infos pratiques

- ECTS : 3.0
- Nombre d'heures : 28.0
- Langue(s) d'enseignement : Français
- Niveau d'étude : BAC +4
- Période de l'année : Enseignement septième semestre
- Méthodes d'enseignement : En présence
- Forme d'enseignement : Cours magistral
- Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- Campus : Campus de Nanterre
- Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- Code ELP : 4E7ORMIA

## Présentation

Plan du cours :

1. Introduction générale
2. Introduction aux marchés financiers
3. La finance en avenir certain
4. Rappels statistiques
5. La finance en avenir incertain
6. Introduction à la théorie du portefeuille
7. La théorie des options
8. Introduction au *pricing* d'options

## Objectifs

Ce cours a pour objectif d'introduire des concepts cruciaux, notamment ceux liés à la théorie moderne du portefeuille, dans l'optique d'acquérir la boîte à outils nécessaire pour la suite des spécialisations en M2.

## Évaluation

Session 1 :

- Formule standard : évaluation écrite (2h)

## Pré-requis nécessaires

Bonnes bases en sciences économiques, statistiques et mathématiques.

## Compétences visées

- Acquérir des connaissances sur les principales classes d'actifs et leur rôle dans l'allocation d'actifs des investisseurs,
- Étudier les fondations de la théorie moderne du portefeuille (attitude face au risque, diversification, frontière efficiente...),
- Introduire la théorie des options.

## Bibliographie

- Aftalion F., Poncet P. et R. Portrait, La Théorie Moderne du Portefeuille, Que sais-je ?, PUF,
- Bodie Z., A. Kane and A. Marcus, Investments, McGraw-Hill,
- Vernimmen, Corporate Finance Theory and Practice, John Wiley and Sons,
- Poncet P. et R. Portrait, Finance de marché, Dalloz,
- Elton E., M. Gruber, S. Brown and W. Goetzmann, Modern Portfolio Theory and Investments Analysis, John Wiley and Sons,
- Cuthbertson K., Nitzsche D., Quantitative Financial Economics, John Wiley and Sons,
- Fabozzi J., Markowitz H., The Theory and Practice of Investment Management (Frank J. Fabozzi Series), Wiley Finance.

## Ressources pédagogiques

Slides + classe interactive et documents complémentaires sur cours en ligne.

# Contact(s)

## > Florent Wabont

Responsable pédagogique  
fwabont@parisnanterre.fr