

Méthodes et Instruments de la Finance

Infos pratiques

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 24.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français, Anglais
- > 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 : 4E7GAMII
- > En savoir plus : <https://sites.google.com/view/m1ea/accueil>

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 : évaluation écrite (2h)

Session 2 : évaluation orale

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