

Marchés et gestion des risques financiers

Niveau d'étude
Bac +5

Composante
**Institut d'Administration
des Entreprises (IAE)**

Période de l'année
Semestre 3

En bref

- # **Langue(s) d'enseignement:** Français
- # **Méthodes d'enseignement:** A distance
- # **Organisation de l'enseignement:** Formation initiale, Formation continue, Contrat d'apprentissage
- # **Ouvert aux étudiants en échange:** Non

Présentation

Description

La gestion des risques sur les marchés et ses conséquences pour la gestion de portefeuille constituent un aspect important des métiers de la finance. Parmi les différents supports d'investissement, les actions et les options sont les plus risqués et ont donné lieu au développement d'outils assez sophistiqués visant à quantifier au mieux leurs comportements. C'est pourquoi dans ce fascicule, afin de ne pas atteindre un trop grand nombre de pages, nous nous focaliserons sur les actions, les options, la gestion de portefeuille, et les mesures qui en découlent.

Objectifs

Le premier chapitre présente succinctement les principaux éléments relatifs au marché des actions et à celui des options. Quelques rappels sont fournis quant au calcul de rentabilité des actions et au fonctionnement des options d'achat et de vente. Dans le deuxième chapitre sont détaillés les éléments liés à la modélisation de la rentabilité et du risque des actions, avec notamment la présentation des modèles MEDAF, APT et les effets de la diversification d'un portefeuille. Le troisième chapitre aborde fournit des instruments de calcul liés à la gestion de portefeuille, à la notion de frontière efficiente et à son estimation. Enfin, le quatrième chapitre est dédié à quelques aspects importants de la gestion quantitative et de la performance des portefeuilles, à savoir l'assurance de portefeuille, l'utilisation d'option et plusieurs indicateurs de performance.

Heures d'enseignement

TD TD 30h

Bibliographie

« Gestion de portefeuille et marchés financiers », P. Alphonse, G. Desmuliers, P. Grandin, et M. Levasseur, éditions PEARSON.

Infos pratiques

Lieu(x)

Poitiers-Centre Ville

En savoir plus

<https://iae.univ-poitiers.fr/formation-a-distance/>