

Gestion des risques financiers

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français, Anglais
- > Niveau d'étude : BAC +5
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique

Présentation

Les risques financiers sont d'une importance considérable pour les entreprises industrielles et commerciales, les banques et les entreprises d'assurance. Les fluctuations des taux de change et des taux d'intérêt, comme le risque de non-paiement ou le risque politique ont un impact sur les comptes de résultat et sur les bilans de ces entreprises, focalisant l'attention des directions générales. Dans ce contexte, il est opportun de connaître les techniques permettant de couvrir ces risques.

Plan du cours :

1. Foreign exchange market presentation.
2. Foreign exchange risk management.
3. Money market & short term interest rates.
4. Interest rate swaps.
5. Interest rate risk management.

Objectifs

Connaître et maîtriser les techniques permettant de couvrir les différents risques. Financiers auxquels sont soumis les entreprises.

Évaluation

Session unique :

Examen écrit sous forme de QCM.

Compétences visées

- Acquérir une connaissance approfondie des différents titres financiers et des marchés sur lesquels ces produits sont négociés.
- Maîtriser les différents mécanismes et les différentes techniques de couverture.

Bibliographie

- Chance D., Brooks R., *An introduction to derivatives & Risk management*, 10th ed., Cengage Learning, 2016.
- Dalbarade J.-M., *Mathématiques des marchés financiers*, 3^e éd., Eska, 2005.
- Eiteman D., Stonehill A., Moffet M., *Multinational Business Finance*, 15th ed., Pearson, 2019.
- Hull J., *Options, futures and other derivatives*, 10th ed., Pearson, 2018.
- Madura J., *Financial Markets and Institutions*, 12th ed., Cengage Learning, 2018.
- Portait R., Poncet P., *Finance de marché*, 3^e éd., Dalloz, 2011.
- Rocchi J.-M. (coordonné par), *MBA Finance*, 2^e éd., Eyrolles, 2017.
- Ross S., Westerfield R., Jaffe J., *Corporate finance*, 10th ed., Mc Graw Hill, 2012.
- Simon Y. (sous la direction de), *Encyclopédie des marchés financiers*, Economica, 1997.
- Simon Y., Morel C., *Finance internationale*, 11^e éd., Economica, 2015.

Contact(s)

> Didier Folus

Responsable pédagogique

dfolus@parisnanterre.fr