

RISQUE FINANCIER ET CLIMATIQUES



ECTS
3 crédits



Composante
École
d'économie
de la
Sorbonne
(EES)



Volume
horaire
18h



Période de
l'année
Automne

plugin.odf:CONTENT_PROGRAM_TAB01_TITLE

Description

Gunther Capelle-Blancard: gunther.capelle-blancard@univ-paris1.fr

L'objectif du cours est d'acquérir les notions fondamentales en mathématiques financières et de familiariser les étudiants avec les principes de base de la finance. Le cours est construit autour du concept d'arbitrage qui est cœur de la théorie financière et qui est développé dans la première partie. La deuxième partie porte sur les méthodes d'actualisation et de calcul de taux d'intérêt. La troisième partie applique ces méthodes à l'analyse des projets d'investissement et à l'évaluation des obligations, puis des actions. La quatrième partie introduit la notion de risque en finance. Le cours s'appuie sur les treize premiers chapitres du manuel « Finance d'entreprise» (Pearson Education), de Jonathan Berk et Peter DeMarzo, adapté par Gunther Capelle-

Blancard and Nicolas Couderc, disponible en anglais ou en français.

Objectifs

Partie III : L'évaluation des actifs – principes de base

7. La planification financière (*en fonction du temps disponible uniquement*)

8. L'évaluation des obligations

9. L'évaluation des actions

Partie IV : Risque et rentabilité

10. 11. 12. 13. Marchés financiers et mesure des risques

La théorie du choix de portefeuille

Le modèle d'évaluation des actifs financiers

Les modèles alternatifs d'évaluation des actifs

Références :

Berk, DeMarzo, Capelle-Blancard & Couderc, Finance d'entreprise, 5ème édition, Pearson

Education.

<https://www.pearson.fr/fr/book/?GCOI=27440100422430>