

Master Finance

Instruments financiers et risques

Responsable	Descriptions	Informations
Marcel ALOY marcel.aloy@univ-amu.fr	Code : BFIBV2C	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion
	Nature :	Nombre de crédits :
	Domaines : Droit, Économie, Gestion	

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Français

CONTENU

Objectifs :

Depuis la variance jusqu'à la Valeur en Risque et ses extensions, il existe de nombreuses mesures du risque en finance. Ce cours en présente les fondements, les limites et des exemples concrets.

Plan du cours détaillé :

- I. La variance comme mesure du risque : fondements théoriques et limites.
- II. Mesures du risque basées sur les probabilités
- III. Les mesures réglementaires : Valeur en Risque et Expected Shortfall
- IV. La dominance stochastique
- V. Les moments partiels relatifs inférieurs

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Maîtriser les théories des choix en situation d'incertitude (Espérance-utilité, Espérance-variance, Théorie des perspectives)
- Savoir calculer et interpréter les différentes mesures du risque (Variance et moments supérieurs, Valeur en Risque, Expected Shortfall, etc...) sur des données réelles.

MODALITÉS D'ORGANISATION

Cours magistral de 18h.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

J-P. Chavas : Risk Analysis in Theory and Practice, Elsevier, 2004.

T. Roncalli : La gestion des risques financiers. Economica, 2009.

André De Palma, Nathalie Picard, Jean-Luc Prigent : Prise en compte de l'attitude face au risque dans le cadre de la directive MiFID. Cahier de recherche 2009-35. 2009.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

Cours de Statistiques.

Cours de Gestion de Portefeuille.

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Cours d'économétrie.

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 18 heures
- Cours magistraux: 18 heures

CODES APOGÉE

- BFIB02C [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 11/12/2023