

IMFL - UE1 : Gestion de l'entreprise

UE1-3. Gestion du Risque

Objectifs pédagogiques du cours :

Le but de ce cours est d'introduire les principales notions de gestion des risques en entreprise. Pour cela, on commence par les fondements de finance d'entreprise. Puis, on analyse les projets d'investissement. Ensuite, on étudie la gestion des risques. On termine par la gestion de portefeuille.

Pré-requis : Mathématiques financières, Statistiques et finance d'entreprise.

Programme détaillé :

Chapitre 1 : Fondements

- La valeur actuelle en avenir certain
- La valeur actuelle en avenir incertain

Chapitre 2 : Analyse de projets d'investissement

- Critère de décision
- Éléments à prendre en compte dans le calcul de la VAN
- Analyse des déterminants de la valeur
- Flexibilité de la décision
- Financement des projets

Chapitre 3 : Gestion des risques

- Pourquoi gérer les risques ?
- Quels risques ?
- La mesure du risque
- Comment gère-t-on les Risques ?

Chapitre 4 : La gestion de portefeuille

- Comportement de l'investisseur envers le risque
- La gestion de portefeuille
- Portefeuille avec plusieurs actifs risqués

Bibliographie :

- RONCALLI Thierry, La Gestion des Risques Financiers, 2009.
- FARBER André et al. ; Finance, 2009.
- PIERANDREI Laurent et al. ; Risk management : gestion des risques en entreprise, banque et assurance, 2015.