

Université d'Artois – Université de Lille 1

Master 2 Banque – Finance
Année Universitaire 2011/2012

TITRE DU COURS : GESTION DES RISQUES DE MARCHÉ (M2 – BF)

Nom de l'enseignant : Jean-Baptiste DESQUILBET

Volume horaire du cours : 18 h CM – 0 h TD

Coefficient de la matière (Nombre de crédits ECTS) : 4

Présentation succincte de la matière :

Le cours présente les modalités de gestion des risques de marché.

Sommaire ou plan du cours :
(sous réserve de modification)

1. Principes de gestion des risques.
2. Comment les traders gèrent les risques
3. La Value at Risk
4. La volatilité et les corrélations
5. Gestion du risque de taux
6. Gestion du risque de change

Indications bibliographiques :

Manuels de référence :

Hull, John (2010), *Gestion des risques et institutions financières*, Pearson education, 2ème édition
d'Arvisenet, Philippe (2008), *Finance internationale*, Collection Gestion Sup, Dunod, 2ème édition

Autres références utiles :

Bodie, Zvi & Robert Merton (2007), *Finance*, Pearson Education 2ème édition

Farber, André, Marie-Paule Laurent, Kim Oosterlinck, Hugues Pirotte, *Finance*, 2e édition,
Collection Synthex économie gestion, Pearson Education, 2008

Fontaine, Patrice, & Carole Gresse (2003), *Gestion des risques internationaux*, HyperCours, Dalloz.

Jacquillat, Bertrand, Bruno Solnik & Christophe Pérignon, *Marchés Financiers*, Dunod, 5^{ème} édition,
2009

Poncet, Patrice & Roland Portrait (2008, 2012), *Finance de Marché*, Dalloz

consulter <http://jean-baptiste.desquilbet.org/>

Modalités de contrôle des connaissances :

Travail à rendre à l'issue du cours.