

Université d'Artois

FICHE ENSEIGNEMENT UFR EGASS – Année Universitaire 2007/2008

TITRE DU COURS : THEORIE ET GESTION DES RISQUES (M2 – FI)

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) : 2

Présentation succincte de la matière :

Le cours comprend deux parties :

- 1- des éléments de théorie du risque : lien entre aversion au risque et richesse, mesure du risque et variance, partage des risques
- 2- des éléments de gestion des risques : principes (diversification, assurance, couverture), contrats à terme et futures, options.

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

1^{ère} partie : éléments de théorie du risque

- 1- Les individus plus riches sont-ils moins risco-phobes ?
- 2- Peut-on dire qu'une richesse aléatoire est plus « grande », plus « risquée » qu'une autre ?
- 3- Comment partager les risques entre individus ?

2^{ème} partie : éléments de gestion des risques

- 1- Principes de gestion des risques
- 2- Contrats à terme et futures
- 3- Options

Indications bibliographiques :

Polycopiés éventuels :
voir <http://jean-baptiste.desquilbet.org/>

Manuels de référence :
Cayatte, *Introduction à l'économie de l'incertitude*, DeBoeck-Université [pour la 1^{ère} partie du cours]
Bodie & Merton, *Finance*, Pearson Education [pour la 2^{ème} partie du cours]

Modalités de contrôle des connaissances :

Contrôle continu : aucun
Examen terminal : examen oral.