

Vient de paraître ....

## *Marchés Financiers - Gestion de portefeuille et des risques*

Par Bruno Solnik, Christophe Pérignon et Bertrand Jacquillat

Editions Dunod



Cet ouvrage présente les concepts et les techniques modernes d'analyse des marchés financiers, leurs applications à la gestion de portefeuille et, plus globalement, à la gestion des risques.

Il permet au lecteur de se familiariser avec : le cadre institutionnel et opérationnel ; l'efficacité ; le risque, la diversification et la frontière efficace ; les modèles à facteurs ; les modèles d'équilibre des actifs financiers et le prix du risque ; les modèles d'évaluation ; les obligations et taux d'intérêt ; les instruments de gestion des risques ; les contrats à terme ; les options ; la mesure de la performance ; les éléments de gestion de portefeuille.

Cette 5<sup>ème</sup> édition, entièrement mise à jour, s'enrichit de 3 nouveaux chapitres :

- une présentation approfondie du cadre opérationnel des marchés financiers,
- l'utilisation des options en pratique,
- la gestion des risques de marché.

Écrit avec un souci constant de clarté, privilégiant les applications plutôt que les longues démonstrations mathématiques, et illustré par de nombreux exemples, cet ouvrage s'adresse aussi bien aux étudiants qu'aux professionnels de la finance.

**Bruno Solnik** - Polytechnicien et PhD du MIT, il a enseigné la finance à Stanford, Berkeley, Dauphine, université de Genève, UNSW et université de Tokyo. Il est professeur de finance à HEC Paris et à Hong Kong University of Science and Technology.

**Christophe Pérignon** - Détenteur d'un PhD du Swiss Finance Institute, il a été chercheur post-doctoral à UCLA et professeur de finance à l'université Simon Fraser. Il est professeur associé de finance à HEC Paris.

**Bertrand Jacquillat** - Professeur des universités à Sciences Po Paris, cofondateur et président d'Associés en Finance, il a enseigné à HEC Paris, à l'Insead et aux universités de Berkeley et Stanford. Il est membre du Conseil d'Analyse Économique auprès du Premier ministre et vice-président du Cercle des Économies.

Contact Presse HEC Paris : Stéphanie Lorette, 01 39 67 94 39, [lorette@hec.fr](mailto:lorette@hec.fr)