

Portfolio Management

EM364M01B1

Programme

PGE
PGE 2A - Finance - Comptabilité

UE

Gestion de portefeuille

Semestre

B

Discipline

Finance

Volume horaire

20 H

Nombre de places

45

Ouvert aux visiteurs

Oui

Langue



Responsable



Alexis LEVY

Liste des intervenants

Intervenant(s)	Email	Volume horaire CM
Alexis LEVY	ape.levy@gmail.com	20 h

Contribution pédagogique du cours au programme

LEARNING GOAL 1 : Les étudiants maîtriseront les connaissances et les outils les plus récents dans les domaines du management en général.

Students will identify a business organization's operational and managerial challenges in a complex and evolving environment.

Les étudiants identifieront les enjeux stratégiques et managériaux d'une entreprise dans un environnement complexe et en mutation.

Students will understand state-of-the-art management concepts and tools and use them appropriately.

Les étudiants maîtriseront les concepts et outils managériaux les plus récents et sauront les utiliser de manière appropriée.

Students will implement appropriate methodologies to develop appropriate solutions for business issues.

Les étudiants mettront en œuvre des méthodologies adéquates afin de trouver des solutions adaptées aux problématiques d'entreprise.

LEARNING GOAL 2 : Les étudiants développeront des compétences managériales de niveau avancé.

Students will communicate ideas effectively, both orally and in writing, in a business context.

Les étudiants communiqueront efficacement leurs idées à l'oral et à l'écrit dans un contexte professionnel.

Descriptif

Ce cours vise à introduire les notions fondamentales de la gestion de portefeuille actions et obligataire.

Organisation pédagogique

Face à face

- Cours magistral

En groupe

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Interactivité

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Autres

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Objectifs pédagogiques

Domaine cognitif

A l'issue du cours, l'étudiant(e) devrait être capable de / d'...

- - (niv. 1) **Décrire** les notions fondamentales de diversification de portefeuille et de risque
- - (niv. 3) **Utiliser** les outils statistiques fondamentaux en gestion de portefeuille Identifier la nature des risques selon les titres détenus
- - (niv. 4) **Choisir** les mesures de performances pertinentes en gestion de portefeuille
- - (niv. 5) **Discuter** de la pertinence des mesures de performance
- - (niv. 6) **Estimer** les risques associés à un portefeuille de titres

Domaine affectif

A l'issue du cours, l'étudiant(e) devrait être capable de / d'...

Aucun domaine affectif n'a pour le moment été associé à ce cours

Plan / Sommaire

Introduction

Partie I : Les portefeuilles obligataires

- I)a) Les fondamentaux
- I)b) Caractéristiques des obligations
- I)c) Risques associés à ces titres
- I)d) Structures par termes des taux

Partie II : La diversification

- II)a) Diversification : Définition
- II)b) La frontière efficiente
- II)c) Diversification : Quelques éléments empiriques

Parie III : CAPM et Gestion de Portefeuilles
III)a) Le MEDAF et ses implications
III)b) Les mesures de performances
III)c) Le modèle de marché

Prérequis nécessaires

Connaissances en / Notions clés à maîtriser

Statistiques de base
Cours de finance introductif

Supports pédagogiques

Outils obligatoires pour le cours

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Documents tous formats

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Plateformes Moodle

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Logiciels

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Autres plateformes électroniques

Aucun élément de cette liste n'a été coché.

Bibliographie recommandée

Ouvrages principaux

Hamon, Bourse et gestion de portefeuille

Bodie, Kane, Marcus, Investments and portfolio management

Elton, Gruber, Brown, Goetzmann, Modern portfolio theory and investment analysis

Littérature complémentaire

Aucun ouvrage n'a été renseigné.

Travaux de recherche de l'EM : Veillez à mobiliser au moins une ressource

Peuvent être renseignés les manuels coordonnés, les traductions de manuel, les études de cas traduites etc...
Aucun ouvrage n'a été renseigné.

Modalités d'évaluation

Liste des modalités d'évaluation

Evaluation finale Semaine d'examens
Ecritte (120 min) / individuelle / Français / pondération : 100 %
Cette évaluation sert à mesurer L01.2, L01.3, L02.2