

Gestion de portefeuille (EM054M5GB1)

Programme	PGE
Unité d'enseignement / ECTS / Parcours/Spécialisation(s)	UE : Gestion de portefeuille : 3 ECTS. <ul style="list-style-type: none">• PGE 2A - Management Général Avancé (MGA)
Discipline	Finance
Année	2019
Semestre	B
Ouvert aux visiteurs	oui (3 ECTS)
Nombre de places disponibles	40

Responsable du cours

Alexis LEVY

Intervenants

Intervenant	Population	Mail
Alexis LEVY	Population	

Format du cours

Langue de travail :	Français
Volume horaire en présentiel :	20 h
Heures de travail totales à prévoir par l'étudiant :	60 h

Track du cours

Track : Présentiel

Track "Présentiel" :

La présence en cours / TD ainsi que la participation aux contrôles continus et terminaux sont obligatoires. L'évaluation vise à valoriser le travail en présentiel, toute absence non justifiée sera sanctionnée (cf. règlements de scolarité) et prise en compte au niveau de la notation (cf. modalités d'évaluation).

Track "Autonome" :

La participation aux contrôles continus et terminaux est obligatoire. L'étudiant est libre d'assister ou non au cours.

Dans toutes les formations Masters et celles réalisées en apprentissage, la présence en cours / TD et aux épreuves intermédiaires et terminales est entièrement obligatoire. Seul le track « Présentiel » est possible.

Contribution pédagogique du cours au programme

En quoi ce cours participe au programme :

Descriptif

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

Organisation pédagogique

Face-à-face

Cours magistral

Objectifs pédagogiques

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

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

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

Partie 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

Notions clés à maîtriser :

Cours de finance introductif

Connaissances en :

Statistiques de base

Supports pédagogiques

Documents tous formats

- Guide

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 :

Travaux de recherche de l'EM :

Modalités d'évaluation

Evaluation finale : semaine d'examens

écrite (120 min) / individuelle / Français / pondération : 100%

Cette évaluation sert à mesurer LO1.2, LO1.3, LO2.2

Motifs d'exclusion du cours

Les comportements tels que...

arrivées tardives / départs anticipés / sorties de salle intempestives pendant le cours

consommation ostentatoire de nourriture et de boissons

utilisation de smartphones & d'ordinateurs portables pour des raisons non liées au cours

lectures non liées au cours

discussions non liées au cours

comportements irrespectueux vis-à-vis de l'enseignant

... peuvent conduire à l'exclusion du cours.