

Information : Ce plan de cours est celui du cours **EM054M5GB1**.

Gestion de portefeuille (EM054M5GB2)

Programme	PGE
Unité d'enseignement / ECTS / Parcours/Spécialisation(s)	UE : Gestion de portefeuille : 3 ECTS. ● PGE 2A - Management Général Avancé (MGA)
Discipline	Finance
Année	2020
Semestre	B
Ouvert aux visiteurs	non
Nombre de places disponibles	50

Responsable du cours

Alexis LEVY

Intervenants

Intervenant	Population	Mail
Alexis LEVY		

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 :

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.

Descriptif

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

Organisation pédagogique

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 intermédiaire / contrôle continu 1 :

écrite (30 min) / individuelle / Français / pondération : 30%
Cette évaluation sert à mesurer LO1.2, LO1.3, LO2.2

Evaluation finale : semaine d'examens

écrite (120 min) / individuelle / Français / pondération : 70%
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.