

# Gestion de portefeuilles

## Infos pratiques

---

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 40.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +4
- > Période de l'année : Enseignement huitième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 4E8GAGPM

## Présentation

---

L'enseignement présente les grands principes de la gestion de portefeuille et le choix d'allocation.

Le cours s'articule autour de 5 chapitres :

- \* Introduction aux notions de Gestion d'Actifs,
- \* Théorie des choix d'investissement en univers incertain,
- \* Eléments d'analyse des portefeuilles d'actifs,
- \* Critère Espérance-Variance et analyse des portefeuilles efficients,
- \* Le MEDAF ou Modèle d'Evaluation des Actifs Financiers.

## Objectifs

---

L'enseignement a pour but de préparer les étudiants au milieu de l'Asset Management en intégrant les principes théoriques du choix de portefeuille avec l'appui de mon expérience. Au cours du semestre, les universitaires aborderont des principes ou instruments financiers afin d'étoffer leur vocabulaire et leur connaissance du milieu.

## Évaluation

---

Évaluation écrite (partiel traditionnel), Contrôle continu

## Pré-requis nécessaires

---

- \* Les étudiants devront présenter une appétence à la Finance générale et sa culture.
- \* Avoir de bonnes bases mathématiques et statistiques.
- \* Avoir suivi un cours d'économie dans l'incertain.
- \* Usage du logiciel R.

## Compétences visées

---

Choix de portefeuille, Modèle d' Evaluation des Actifs Financiers, Instruments Financiers, Culture Financières, Critère Espérance/Variance, Principe de base du Risk Management.

## Bibliographie

---

- \* Finance de marché: Instruments de base, produits dérivés, portefeuilles et risques - Patrice Poncet
- \* Options, futures et autres actifs dérivés - John Hull
- \* Financial Risk Manager Handbook - Philippe Jorion
- \* Standards of Practice Handbook - CFA Institute

## Ressources pédagogiques

---

Classe interactive