





| | | |
|-------------|----------------|----|
| 5.0 crédits | 30.0 h + 0.0 h | 2q |
|-------------|----------------|----|

| | |
|---|--|
| Enseignants: | D'Hondt Catherine ; |
| Langue d'enseignement: | Français |
| Lieu du cours | Mons |
| Préalables : | Aucun (au niveau du Master) |
| Thèmes abordés : | <p>L'objectif de ce cours est d'apprendre aux étudiants à maîtriser les aspects théoriques et pratiques essentiels de la gestion d'actif.</p> <p>Les thèmes abordés sont les suivants.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Les mesures du rendement et du risque (pour des portefeuilles investis en actions, obligations, et dérivés) - Les techniques de construction et de gestion de portefeuille - L'attribution de performance les règles de présentation - La gestion de fortune (Wealth Allocation Framework) |
| Acquis d'apprentissage | <p>Au terme de cet enseignement, l'étudiant sera capable de:</p> <ul style="list-style-type: none"> - calculer le rendement et le risque d'actifs financiers à l'aide d'un tableur et du logiciel R; - sélectionner les méthodes de calcul du rendement et du risque les plus adaptées à la stratégie de gestion de portefeuille suivie par l'investisseur; - analyser la composition du portefeuille d'investisseurs fortunés et émettre des recommandations éventuelles de modification; - évaluer le bien-fondé des méthodes de gestion active et passive; - construire et évaluer son propre portefeuille en sélectionnant et en combinant plusieurs titres financiers. <p><i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i></p> |
| Modes d'évaluation des acquis des étudiants : | <ul style="list-style-type: none"> - Questions basé sur un tableur - QCM - Questions ouvertes |
| Méthodes d'enseignement : | <ul style="list-style-type: none"> - Cours exigeant une lecture préalable - QCM - Applications en Excel - Tutoriels vidéo - Simulation de portefeuille |
| Contenu : | <p>Le cours puise son contenu dans la liste des éléments suivants.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Risque, rendement, planification et construction de portefeuille - Gestion active de portefeuille - Enoncé de la politique de placement - Placements alternatifs: Investir dans les 'matières premières', l'immobilier, les fonds de placement privés (private equity funds), les fonds spéculatifs (Hedge Funds) - Gestion privée de patrimoine et gestion de portefeuille pour les investisseurs institutionnels - L'allocation d'actifs - Gestion de portefeuille obligataire - Gestion de portefeuille d'actions - Gestion des risques pour les stratégies sur devises à |

| | |
|--|---|
| | <p>terme et contrats à terme, options et swaps</p> <ul style="list-style-type: none"> - Exécution des décisions de portefeuille - La surveillance et le rééquilibrage des portefeuilles - Évaluation de la performance du portefeuille - Evaluation globale de la performance - Normes de performance globale d'investissement |
| <p>Bibliographie :</p> | <p>Bacon (2008), Practical Portfolio Performance Measurement and Attribution, 2nd ed., Wiley. Bodie, Kane et Marcus (2010), Investments, 9th edition, McGraw-Hill. Roncalli (2013), Introduction to Risk Parity and Budgeting, Chapman & mp; HallCRC Financial Mathematics Series.</p> |
| <p>Faculté ou entité en charge:</p> | <p>BLSM</p> |

| Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE) | | | | |
|--|--------|---------|-----------|---|
| Intitulé du programme | Sigle | Crédits | Prérequis | Acquis d'apprentissage |
| Master [120] en sciences de gestion | GEST2M | 5 | - |  |
| Master [120] en sciences de gestion | GESM2M | 5 | - |  |
| Master [120] en ingénieur de gestion | INGM2M | 5 | - |  |
| Master [120] en ingénieur de gestion | INGE2M | 5 | - |  |