



| | | |
|--------------|--------|----|
| 6.00 crédits | 30.0 h | Q2 |
|--------------|--------|----|

| | |
|---|---|
| Enseignants | Vrins Frédéric ; |
| Langue d'enseignement | Français |
| Lieu du cours | Mons |
| Préalables | Aucun (au niveau du Master) <i>Le(s) prérequis de cette Unité d'enseignement (UE) sont précisés à la fin de cette fiche, en regard des programmes/formations qui proposent cette UE.</i> |
| Thèmes abordés | L'objectif de ce cours est d'apprendre aux étudiants à maîtriser les aspects théoriques et pratiques essentiels de la gestion d'actifs financiers. Les thèmes abordés sont les suivants. - 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 principes de la gestion de fortune (Wealth Allocation Framework) |
| Acquis d'apprentissage | A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de : Au terme de cet enseignement, l'étudiant sera capable de: - calculer le rendement et le risque d'actifs financiers (à l'aide d'une calculatrice et d'un tableur); - sélectionner les méthodes de calcul du rendement et du risque les plus adaptées à la stratégie de gestion de portefeuille suivie par l'investisseur; ¹ - 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. |
| Modes d'évaluation des acquis des étudiants | <ul style="list-style-type: none"> • Analyse de cas: travail de groupe (rapport + présentation orale; 25% de la note finale) • Examen écrit en session (75% de la note finale) <p>Remarque importante sur le plagiat et l'utilisation de l'IA générative</p> <p><i>En soumettant un travail pour évaluation, vous affirmez que :</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>celui-ci reflète fidèlement les faits et pour ce faire, vous devez les avoir vérifiés, surtout s'ils proviennent de ressources d'IA générative ;</i> • <i>toutes vos sources qui vont au-delà de la connaissance commune sont dûment attribuées. La connaissance commune est ce qu'un lecteur averti peut évaluer sans avoir besoin de confirmation d'une source distincte ;</i> • <i>vous avez respecté toutes les exigences spécifiques du travail qui vous a été confié, en particulier les exigences de transparence et de documentation du processus, ou vous avez expliqué lorsque cela n'était pas possible.</i> <p><i>Si l'une de ces affirmations n'est pas vraie, que ce soit intentionnellement ou par négligence, vous avez violé votre engagement envers la vérité et éventuellement d'autres aspects de l'intégrité académique. Cela constitue une faute académique.</i></p> |
| Méthodes d'enseignement | - Cours magistral en français - Diapositives et livres de référence en anglais |
| Contenu | 1. Partie I: Concept et mesure du risque 2. Partie II: Gestion du risque associés aux actions 3. Partie III: Titres à revenus fixe: gestion du risque associés aux obligations et crédits |
| Bibliographie | <ul style="list-style-type: none"> • John C. Hull , Risk Management and Financial Institutions, 5th edition, Wiley (2018) • Frey and Mc Neil & Embrechts, Quantitative Risk Management: : Concepts, Techniques and Tools - Revised Edition, Princeton Series in Finance |

| | |
|------------------------------|------|
| Faculté ou entité en charge: | CLSM |
|------------------------------|------|

| Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE) | | | | |
|--|--------|---------|-----------|---|
| Intitulé du programme | Sigle | Crédits | Prérequis | Acquis d'apprentissage |
| Master [120] en sciences de gestion (horaire décalé) | GEHC2M | 6 | |  |
| Master [120] en sciences de gestion (horaire décalé) | GEHM2M | 6 | MGEHD2134 |  |