

Contenus

Nom du Cours		Semestre du Cours	Cours Théoriques	Travaux Dirigés (TD)	Travaux Pratiques (TP)	Crédit du Cours	ECTS
G451	Gestion de portefeuille	7	3	0	0	3	5

Cours Pré-Requis	G352
Conditions d'Admission au Cours	G352

Langue du Cours	Anglais
Type de Cours	Électif
Niveau du Cours	Licence
Objectif du Cours	L'objectif de ce cours est de permettre aux étudiants de comprendre les marchés financiers, les institutions et les instruments d'investissement, et de développer la capacité de constituer, gérer et évaluer des portefeuilles d'investissement. En plus de l'apprentissage des modèles théoriques fondamentaux, les étudiants examineront différentes stratégies de portefeuille et des pratiques de gestion des risques, et développeront ainsi une perspective analytique et critique dans leurs décisions d'investissement.
Contenus	1) Introduction à la gestion de portefeuille 2) Marchés financiers, institutions et microstructure de marché 3) Fondements de l'évaluation : risque et rendement 4) Instruments financiers I : obligations et actions 5) Instruments financiers II : fonds communs de placement et ETF 6) Examen partiel 7) Théorie du portefeuille 8) Modèles d'évaluation des actifs : MEDAF (CAPM) et modèles multifactoriels 9) Applications en gestion de portefeuille I : investissement passif vs actif, stratégies d'allocation d'actifs 10) Applications en gestion de portefeuille II : stratégies factorielles, résultats empiriques et anomalies 11) Applications en gestion de portefeuille III : analyse technique, stratégies neutres au marché, investissement ESG 12) Évaluation de la performance du portefeuille 13) Produits dérivés et gestion du risque de portefeuille 14) Présentations des étudiants
Ressources	- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2023). Investments, (13th ed.). McGraw Hill LLC. - Reilly, F. K., Brown, K. C., & Leeds, S. J. (2019). Investment Analysis and Portfolio Management, (11th ed.). Cengage Learning. - Bolak, M. (2001). Sermaye Piyasası, Menkul Kıymetler ve Portföy Analizi, 4.basım. Beta Basım.

Intitulés des Sujets Théoriques

Semaine	Intitulés des Sujets
1	Introduction à la gestion de portefeuille
2	Marchés financiers, institutions et microstructure de marché
3	Fondements de l'évaluation : risque et rendement
4	Instruments financiers I : obligations et actions
5	Instruments financiers II : fonds communs de placement et ETF
6	Examen partiel

Semaine	Intitulés des Sujets
7	Théorie du portefeuille
8	Modèles d'évaluation des actifs : MEDAF (CAPM) et modèles multifactoriels
9	Applications en gestion de portefeuille I : investissement passif vs actif, stratégies d'allocation d'actifs
10	Applications en gestion de portefeuille II : stratégies factorielles, résultats empiriques et anomalies
11	Applications en gestion de portefeuille III : analyse technique, stratégies neutres au marché, investissement ESG
12	Évaluation de la performance du portefeuille
13	Produits dérivés et gestion du risque de portefeuille
14	Présentations des étudiants