

5.0 crédits

30.0 h

1q

Enseignants:	Petitjean Mikael ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Mons
Préalables :	Risk and Ethics in Finance
Thèmes abordés :	<ul style="list-style-type: none"> · Portfolio Risk, Return, Planning and Construction · Active Portfolio Management · Portfolio Management Process and Investment Policy Statement · Alternative investments: Investing in Commodities, Real Estate, Private Equity and Hedge Funds · Private Wealth Management · Portfolio Management for Institutional Investors · Capital Market Expectations in Portfolio Management · Economic Concepts for Asset Valuation in Portfolio Management · Asset allocation · Fixed-Income Portfolio Management · Relative-Value Methodologies for Global Credit Bond Portfolio Management · Hedging Mortgage Securities to Capture Relative Value · Equity Portfolio Management · Alternative Investments Portfolio Management (Swaps, Commodity Forwards and Futures) · Risk Management for Strategies on Currencies, Forward and Futures, Options, and Swaps · Execution of Portfolio Decisions · Monitoring and Rebalancing of Portfolios · Evaluating Portfolio Performance · Global Performance Evaluation Global Investment Performance Standards
Acquis d'apprentissage	At the end of this course, students will be able to understand the foundations of portfolio management, including risk management and alternative investments. <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>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	Written examens (on computer)
Méthodes d'enseignement :	<ul style="list-style-type: none"> ' Lectures based on readings ' MCQs ' Excel applications Video tutorials
Bibliographie :	<ul style="list-style-type: none"> ' Bodie, Kane et Marcus (2010), Investments, 9th edition, McGraw-Hill. ' BODSON, L., Grandin P., Hübner G., Lambert M.(2010), Performance de portefeuille, 2nd edition, Pearson Education. ' CFA INSTITUTE (2012), Level I Program Curriculum, Study Sessions 12 and 18. ' CFA INSTITUTE (2012), Level II Program Curriculum, Study Sessions 13 and 18. ' CFA INSTITUTE (2012), Level III Program Curriculum, Study Sessions 4 to 18.
Cycle et année d'étude: :	<ul style="list-style-type: none"> > Master [120] en ingénieur de gestion > Master [120] en sciences de gestion > Master [120] en ingénieur de gestion > Master [120] en sciences de gestion > Master [60] en sciences de gestion
Faculté ou entité en charge:	BLSM

