



| | | |
|--------------|--------|----|
| 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 | Examen écrit en session |
| Méthodes d'enseignement | - Cours magistral - Slides et livres de référence en anglais |
| Contenu | 1. Part I: Introduction, Financial Institutions and Trading in Financial Markets 2. Part II: Market Risk – Volatility, Dependence, Value-at-Risk, Expected Shortfall 3. Part III: Credit Risk - Rating, Default Probability and Expected Losses |
| Bibliographie | • 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 |  |