

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	