

Gestion de Portefeuille



Niveau d'étude
BAC +4



ECTS
3 crédits



Composante
UFR Sciences
et Techniques

En bref

- > **Langue(s) d'enseignement:** Français
- > **Ouvert aux étudiants en échange:** Non

Présentation

Description

Choix de portefeuille selon les critères moyenne-variance, utilité espérée, dominance stochastique, VaR. Frontière efficiente avec et sans actif sans risque, MEDAF, APT, critères de performance.

Objectifs

Choisir un portefeuille d'actifs parmi plusieurs selon un critère spécifique.

Pondérer chaque actif d'un portefeuille afin d'optimiser un critère spécifique.

Évaluer le prix d'un actif et déterminer si l'actif est sur ou sous-évalué.

Pré-requis obligatoires

Notions de base en probabilités et statistiques.

Contrôle des connaissances

E.T. écrit

Compétences visées

Choix de portefeuille : cas mono-périodique

Allocation d'actifs par approche de Markovitz

Allocation d'actifs par approche de l'utilité espérée

Allocation d'actifs par la méthode de la VaR

MEDAF : Méthodes de contrôle de performances

Liste des enseignements

Nature	CM	TD	TP	Crédits
--------	----	----	----	---------

Infos pratiques

Lieu(x)

› Saint-Étienne-du-Rouvray