

Simulation Portefeuille 2



Niveau d'étude
BAC +5



Composante
UFR Sciences
et Techniques

En bref

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

Présentation

Description

Introduction à la gestion de portefeuilles d'actifs financiers :

- Définition du besoin (rendement et risque)
- Choix d'actifs
- Construction du portefeuille
- Rebalancement et monitoring

Objectifs

Acquérir les compétences nécessaires à la gestion d'un portefeuille d'actifs financiers (étapes du process de gestion, méthodes de gestion, différences entre les actifs ...).

Pré-requis obligatoires

Notions de base sur les marchés financiers (intervenants, actifs, bilan de sociétés, carnets d'ordres).

Notions de base en économie (taux d'intérêt, inflation, cycles économiques).

Notions de base en mathématique (probabilités, distribution gaussienne).

Contrôle des connaissances

Contrôle continu

Compétences visées

- Classes d'actifs (définition, caractéristiques, différences, mode de détention)
- Distinction des différentes parties prenantes (banques, assurances, sociétés de gestion, investisseurs individuels)
- Définition d'une politique d'investissement et des documents d'investissement (DICI, prospectus)
- Actifs à caractères obligataires (impact des caractéristiques du titre sur sa sensibilité), swap, CDS
- Instruments dérivés (Grecques, combinaison de payoff, Black & Scholes)
- Intérêt de la diversification, fonction d'utilité et frontière efficiente
- Méthodes de rebalancement (Buy & hold, Constant mix, CPPI)
- Base de la gestion quantitative (élaboration d'un modèle, optimisation convexe sous contraintes, automatisation)
- Mise en place de couvertures financières
- Méthodes de contrôle de performances (Tracking Error, Sharpe, Beta, VaR...)

Infos pratiques

Lieu(x)

› Saint-Étienne-du-Rouvray