

## SYLLABUS MFA-615-2020 GESTION DE PORTEFEUILLE

**Durée : 30H**

**Langue : Français**

ANIME PAR

**LOCUSSOL Henry-René** Président-Fondateur de Numa Finance  
& Intervenant à l'école de Management Audencia (France)

### ► **DESCRIPTION DU COURS**

Après avoir suivi ce cours, vous serez capable de

- ✓ Décrire les marchés financiers
- ✓ Classifier des actifs
- ✓ Mesurer un risque
- ✓ Evaluer un actif
- ✓ Sélectionner un investissement
- ✓ Construire un portefeuille financier
- ✓ Formuler des hypothèses

### ► **OBJECTIF DU COURS**

L'objectif principal de ce cours est la maîtrise des concepts, des questions, des méthodes et des pratiques sectorielles pertinentes dans le cadre de la gestion de portefeuille

### ► **COMPÉTENCES VISÉES PAR LE COURS**

L002 - Analyse : Analyser des situations complexes

L003 - Analyse : Adopter des approches transversales

L004 - Action : Etre force de proposition, prendre des initiatives

L007 - Entrepreneuriat et innovation : Identifier les besoins et élaborer une offre pertinente

L009 - Entrepreneuriat et innovation : Elaborer des solutions innovantes et les expérimenter

### ► **CONCEPTS ENSEIGNÉS**

- ✓ Marchés financiers
- ✓ Choix d'investissement

- ✓ Mesure du risque
- ✓ Valorisation d'actif (CAPM, APT)
- ✓ Finance comportementale
- ✓ Fonction d'utilité
- ✓ Allocation d'actif
- ✓ Gestion passive
- ✓ Gestion active

► **MÉTHODE PEDAGOGIQUE**

Cours, études de cas et discussions

► **TRAVAIL ATTENDU**

Le cours nécessite du travail personnel (révision, exercices complémentaires)

► **BIBLIOGRAPHIE**

Investment Analysis and Portfolio Management, 2008, Frank K. Reilly, ed:South-Western College Pub, ISBN-10:0324656122

► **MÉTHODE D'ÉVALUATION**

100 % : Examen Final sous forme d'1 QCM sans documents et sans calculatrice.

► **SÉANCES**

**1**

**Introduction à la finance, au risque et à la théorie de portefeuille**  
COURS :03h00

---

**2**

**Rappels sur les produits financiers**  
COURS :03h00

---

**3**

**Définir le risque et l'espérance mathématique**  
COURS :03h00

---

4

**Le modèle de valorisation d'actif CAPM**

COURS :03h00

---

5

**Les espérances de rendement et la théorie de l'arbitrage**

COURS :03h00

---

6

**La construction d'un portefeuille**

COURS :03h00

---

7

**Le cout de transaction, le turnover et le trading**

COURS :03h00

---

8

**L'analyse de performance**

COURS :03h00

---

9

**L'allocation d'actif**

COURS :03h00

---

10

**Construction d'un processus de gestion global**

COURS :03h00

---