

GFN206 - Gestion d'actifs et des risques

Présentation

Prérequis

[Demandez un agrément à cette unité d'enseignement](#) et envoyez à boris.buljan@lecnam.net

Public niveau bac+4, possédant une formation en mathématiques appliquées, économétrie, économie, finance ainsi qu'une culture économique et financière par acquis professionnels.

Objectifs pédagogiques

Acquérir une connaissance des méthodes et des stratégies de gestion d'actifs et d'analyse des risques.

Compétences

Programme

Contenu

Gestion des risques financiers

Value at risk (risk metrics, Monte Carlo)

Risque de crédit

Contrôle des risques (banques et assurances).

Styles de gestion d'actifs

Analyse et recherche

Méthodes de sélection des valeurs (éléments de stock picking) et procédures d'allocation d'actifs

Stratégies concaves et convexes : assurance de portefeuille, gestion active, gestion avec benchmark.

Mesures globales de performance

Trois cas de simulation de stratégies de portefeuille et de calcul de la VaR

Modalités de validation

- Examen final

Description des modalités de validation

Bibliographie

| Titre | Auteur(s) |
|--|-------------------------------------|
| Gestion de portefeuille (Dunod, 2017) | ESTRAN R., E. HARB et I. VERYZHENKO |
| La gestion de portefeuille: Instruments, stratégie et performance (De Boeck 2015) | COBBAUT R., R. GILLET et G. HUBNER, |

Mis à jour le 26-04-2018



Code : GFN206

Unité d'enseignement de type cours

6 crédits

Volume horaire de référence (+/- 10%) : **50 heures**

Responsabilité nationale :

EPN09 - Economie Finance

Assurance Banque (EFAB) / 1

Contact national :

EPN09 - département EFAB

292 rue Saint Martin

accès 3

75003 Paris

01 58 80 87 45

Boris Buljan

boris.buljan@lecnam.net