



MASTER II BANQUE, FINANCE ET NEGOCE INTERNATIONAL

GESTION DE PORTEFEUILLE

Pr Emmanuelle Gabillon

2006 - 2007

OBJECTIFS DU COURS :

L'objectif du cours est de familiariser les étudiants avec les principes des différentes méthodes de gestion de portefeuille d'actions.

CONTENU DU COURS

Dans ce cours, après un bref rappel sur le CAPM, nous présentons un panorama des différentes méthodes de gestion de portefeuille et nous approfondissons les méthodes de gestion active par rapport à un benchmark et les méthodes de gestion passive (gestion indicielle et gestion structurée).

BIBLIOGRAPHIE

Gestion de portefeuille, C. Broquet, R. Cobbaut, R. Gillet, A. van den Berg, 4^{ème} édition. Marchés financiers, de Boeck.

Gestion de portefeuille et des risques, B. Jacquillat, B. Solnik, Dunod.

Gestion quantitative de portefeuille d'actions, N. Amenc et V. Le Sourd, Economica.