Cours de spécialisation I

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Cet enseignement est composé de deux cours. **1/ Analyse de performance d'investissement** Objectif : Acquérir les savoirs et savoir-faire de base de l'analyse de performance. Sensibiliser les futurs professionnels de la gestion d'actifs sur les problématiques de performance. Mise en application par des calculs. Grands chapitres : 1. Mesure de performance, A. Définitions et utilisations B. Propriétés mathématiques des performances C. Méthodes de calcul de la performance D. Différent types de performance 2. Attribution de performance A. Définitions B. Prérequis C. Attribution de performance d'un portefeuille d'action D. Attribution obligataire E. Chaînage sur plusieurs périodes. **2/Gestion structurée, indicielle et diversifiée** Objectif: Comprendre en quoi consiste le travail d'un gérant. Comprendre comment sont gérés les fonds garantis ou protégés, que ce soit sous la forme de fonds à formule ou de fonds gérés avec la méthode du coussin. Connaitre les différentes techniques de réplication et le monde des ETF. Comprendre les modifications créées par le développement de l'ESG. Comprendre ce qu'est la gestion diversifiée, les différences entre la gestion active et la gestion passive, comment un gérant prend des décisions d'investissement en gestion active et les spécificités de la gestion dans le but de la retraite. Grands chapitres: 1.Le rôle du gérant. 2.La gestion des fonds à coussin. 3.La gestion des fonds à formule. 4.La gestion indicielle et le monde des ETF. 5. La gestion diversifiée.

Compétence à acquérir :

Gestion de portefeuilles

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16