

Descriptif de module

Domaine : Economie & Services
Filière : Economie d'entreprise
Orientation : Banque et Finance

1. Intitulé de module **B&F : Investissements ESG et Gestion de Portefeuille ESG** **2024-2025**

Code : 51343

Type de formation :

Bachelor Master MAS DAS CAS Autres :

Niveau :

- Module de base
 Module d'approfondissement
 Module avancé
 Module spécialisé
 Autres :

Caractéristique :

Module obligatoire dont l'échec peut entraîner l'exclusion définitive de la filière selon l'art.25, du Règlement sur la formation de base (Bachelor et Master) en HES-SO

Type :

- Module principal
 Module lié au module principal
 Module facultatif ou complémentaire
 Autres :

Organisation temporelle :

- Module sur 1 semestre
 Module sur 2 semestres
 Semestre d'automne
 Semestre de printemps
 Autres :

2. Organisation

Crédits ECTS : 5

Langue principale d'enseignement :

- Français Italien
 Allemand Anglais
 Autres :

3. Prérequis

- Avoir validé le module
 Avoir suivi le module
 Pas de prérequis
 Autres :

4. Compétences visées / Objectifs généraux d'apprentissage

- Comprendre les principes fondamentaux de l'investissement ESG et son importance dans le paysage actuel de l'investissement.
- Distinguer les différents types d'investissement responsable et expliquer les raisons d'intégrer les facteurs ESG dans les décisions d'investissement.
- Décrire l'histoire et la croissance du marché ESG.
- Analyser les principales questions environnementales et leurs relations systémiques avec les marchés financiers.
- Développer des stratégies pour intégrer les facteurs environnementaux importants dans la modélisation financière, l'analyse des ratios et l'évaluation des risques.
- Identifier et appliquer les facteurs sociaux dans les décisions d'investissement, en reconnaissant leur impact sur les activités commerciales et les opportunités d'investissement.
- Comprendre le rôle de la gouvernance dans les investissements.

- Explorer les concepts d'intendance et d'engagement, comprendre leur importance et passer en revue les différents styles et pratiques d'engagement dans les différentes catégories d'actifs.
- Apprendre les différentes approches de l'analyse, de l'évaluation et de l'intégration ESG.
- Devenir expert dans l'évaluation des fonds communs de placement, des entreprises et d'autres véhicules d'investissement d'un point de vue ESG.
- Construire et gérer un portefeuille intégré ESG, en tenant compte de l'allocation stratégique des actifs, de l'indexation et de l'étalement, et de l'application du filtrage ESG dans différentes classes d'actifs.
- Élaborer des mandats d'investissement qui s'alignent sur les convictions ESG des clients, adapter les approches d'investissement ESG aux attentes des clients et garantir la responsabilité grâce à un suivi et à un reporting efficaces.
- Évaluer l'impact des facteurs ESG.

5. Contenu et formes d'enseignement

1. Introduction à l'Investissement ESG
2. Le Marché ESG
3. Les Facteurs Environnementaux
4. Les Facteurs Sociaux
5. Les Facteurs de Gouvernance
6. Engagement et Intendance
7. Analyse, Évaluation et Intégration ESG
8. Construction et Gestion de Portefeuilles Intégrant l'ESG
9. Mandats d'Investissement, Analyse de Portefeuille et Reporting Client.

6. Modalités d'évaluation et de validation

L'évaluation du module est en principe réalisée à travers une combinaison d'un ou de plusieurs contrôles continus et/ou d'un ou de plusieurs travaux de groupe et/ou d'évaluation de la participation et/ou d'autres modalités d'évaluation annoncées en début de semestre.

7. Modalités de remédiation

- Remédiation obligatoire si le résultat du module est compris entre 3,5 et 3,9 / 6.
 Pas de remédiation
 Autres modalités :

Autres modalités de remédiation

En cas de remédiation, seule la note de l'examen de remédiation sera prise en compte.

Un module répété ne peut pas être remédié.

8. Bibliographie

- CFA INSTITUTE, 2021. *Certificate in ESG Investing Curriculum*. 3^{ème} édition. London, UK : CFA society of the UK. Collection O'Reilly. ISBN : 978-1-953337-41-2.