

Statistiques et dynamique des produits dérivés

ECTS : 2

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

- 1/ Approches en probabilité historique (gestion de portefeuille classique), portefeuilles optimaux, beta, arbitrage, APT
- 2/ Valuation de produits dérivés et probabilité risque neutre
- 3/ Trading de volatilité, volatilité locale et calibration
- 4/ Assurance du portefeuille: stop-loss, options, CPPI, CRP - Constant Mix
- 5/ Options exotiques ou cachées: ETF short, etc.

Compétence à acquérir :

approche pratique et empirique des produits dérivés et de la gestion de risques tout en se basant sur une formalisation stochastique avancée

Bibliographie, lectures recommandées :

Voir <https://turinici.com>