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