Gestion des risques et construction de portefeuille

ECTS : 2

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

- rappels du cadre classique : critère moyenne-variance, Markowitz, CAPP, MEDAF
- théorie du portefeuille: indices, portefeuilles optimaux, beta, arbitrage, APT, facteurs
- valuation de produits dérivés et probabilité risque neutre
- trading de volatilité
- assurance de portefeuille: stop-loss, options, CPPI, Buy&Hold, Constant-Mix
- en fonction du temps: deep learning en finance, indicateurs techniques, portefeuille universel

Compétence à acquérir :

cf. descriptif

Bibliographie, lectures recommandées :

cf. site du cours