

## 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