Portfolio management

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

Volume horaire détaillé :
CM : 19h30
TD : 19h30

Théorie de Markowitz pour le choix de portefeuille (critère moyenne-variance) ; notion de portefeuille efficient ; mesure de risque et Value at Risk.

Portefeuille de Marché et Portefeuille Tangent, théorème des deux fonds, modèle du CAPM, équation de la Security Market Line et beta.

Les différents indicateurs : ratio de Sharpe, alpha, ratio de Treynor.

La décompostion et rémunération du risque: modèles à facteurs, modèle de Fama-French, modèles APT.

Analyse factorielle.

Compétence à acquérir :

Ce cours est une introduction aux méthodes quantitatives en gestion de portefeuille.

Mode de contrôle des connaissances :

Partiel, Examen, potentiellement projet en Python

Bibliographie, lectures recommandées :

"Quantitative Portfolio Management", Pierre Brugière, Springer 2020