Gestion de portefeuille et risque

ECTS : 3

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Rendement/risque d'un portefeuille. Théorie moderne de gestion d'un portefeuille. Value atRisk.

Analyse de performance (caractéristiques d'un portefeuille).
Théorie moderne du portefeuille ; le modèle de Markowitz, CAPM.
Gestion/Allocation de portefeuilles et mesures de performance.
Modèles multifactoriels.
Mesures de risque : Value at Risk.