

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.

**Document susceptible de mise à jour - 10/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL** - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16