Gestion des risques et construction de portefeuille

**ECTS** : 2

**Volume horaire** : 15

**Description du contenu de l'enseignement :**

L'objectif de ce cours est de faire découvrir ce qu'est un portefeuille d'actifs ainsi que les méthodes de couverture du risque lié à ce portefeuille.

- 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 :**

Maîtriser les méthodes de couverture du risque lié à un portefeuille d'actifs à travers des exemples.

**Mode de contrôle des connaissances :**

cf. CC

**Bibliographie, lectures recommandées :**

https://turinici.com (y chercher ce cours)