Risk premia

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

L'objectif de ce cours est d'explorer à la fois d'un point de vue théorique et pratique la notion de prime de risque dans un contexte de stratégies d'investissement. La partie théorique s'articule autour des 4 points suivants:

1. Background académique

2. Les primes issues de la recherche académique

3. Les primes de trading

4. Risque, rendement et diversification

La partie pratique de l'enseignement s'attachera à développer complètement une stratégie d'investissement permettant de capturer une prime de risque donné. Le langage de programmation utilisé sera Python.

Compétence à acquérir :

Maitriser les aspects empiriques des modèles d'évaluation d'actifs

Mode de contrôle des connaissances :

Le cours donnera lieu à la réalisation d'un projet.