Gestion de portefeuille (en anglais)

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

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

Portefeuille d'investissement et portefeuille autofinancé, stratégies d'overlay.

Le Modèle du CAPM et la Capital Market Line.

Le portefeuille tangent et les betas, l'équation de la Security Market Line.

Les indicateurs de performance : ratio de Sharpe, alpha de Jansen, ratio de Treynor.

Les modèle à facteurs et le modèle de Fama French. Asset Pricing Theory.

Illustrations et mini projet en Python.

Enseignant responsable : PIERRE BRUGIERE

Compétence à acquérir :

Ce cours est une introduction aux méthodes quantitatives de traitement des données financières et de gestion de portefeuille. L'objectif du cours est de donner un bagage minimal en théorie moderne de la gestion quantitative afin de pouvoir traiter des problèmes pratiques de finance de marché et d'aborder les cours plus spécialisés de finance ou d'économétrie.

Mode de contrôle des connaissances :

Partiel + Examen (+ mini projet)

Bibliographie, lectures recommandées :

Brugiere : Quantitative Portfolio Management (with applications in Python) Springer 2020

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026

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