APT model and methodology

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Rétrospective historique des Modèles de Risque et Théories sous-jacentes

Concepts et Mathématiques des indicateurs de risque généraux avec APT (Volatilité - Tracking Error - Beta - Corrélation...)

Concepts et Mathématiques des indicateurs de risque avancés avec APT (VaR Monte Carlo - Attribution de risque - Stress Testing...)

Cas pratiques d'utilisation des indicateurs de risque pour analyser et gérer les risques de portefeuilles en société de gestion

Evaluation des risques et des performances des fonds

Cas pratiques d'utilisation du risque pour gérer, optimiser et construire des portefeuilles : gestion quantitative avec des préférences explicites, intégration de critères ESG...

Compétence à acquérir :

Suite à la formation l'étudiant aura acquis une compréhension du modèle de risque et de la méthodologie APT.

Le cours vise aussi à montrer l'intérêt de l'approche multifactorielle statistique APT pour:

- comprendre, analyser et gérer les risques de portefeuilles d'actifs financiers.

- utiliser les concepts de risque pour gérer des portefeuilles en société de gestion avec une approche quantitative.

Mode de contrôle des connaissances :

Participation

Travail en groupe

Examen sur table

Bibliographie, lectures recommandées :

Allocation d'Actifs - Théorie et pratiques (Chapitre 6 - Gestion du risque)

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16