

Finance Quantitative

Modèle de Black-Litterman

Le groupe de travail

Version: 11 févr. 2023

- Effectuer une lecture attentive de l'article de He et Litterman.
- A partir de la note de cours, reproduire les autres exemples de l'article, comparer les résultats avec ceux obtenus avec le package BLCOP.
- Comparer avec une allocation MV classique.