

Gestion de Portefeuille

TP-5; Modèle de Black-Litterman

Patrick Hénaff

Février-Mars 2021

- 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.