

OptimRiskMaximizer: Optimisation Avancée du Risque en Trading

OptimRiskMaximizer combine des techniques avancées d'optimisation mathématique pour ajuster

Formule Principale :

$$\text{OptimRisk} = \underset{\omega}{\text{argmin}} (\omega^T \Sigma \omega - \lambda \mu^T \omega)$$

- ω : poids du portefeuille
- Σ : matrice de covariance des rendements
- λ : facteur d'aversion au risque
- μ : rendements moyens