Je comprends mieux maintenant. En effet, si certains rendements sont manquants et remplacés par des valeurs NaN, cela peut conduire à une matrice variance-covariance qui n'est pas définie positive.

Il y a plusieurs façons de traiter les valeurs manquantes dans les données financières. L'une des approches les plus courantes consiste à remplacer les valeurs manquantes par la moyenne des valeurs disponibles dans la colonne correspondante. Cette méthode s'appelle l'imputation par la moyenne et elle est souvent utilisée dans la pratique. Vous pouvez appliquer cette méthode à votre dataframe en utilisant la méthode **fillna** de Pandas :

cov\_matrix = cov\_matrix.fillna(cov\_matrix.mean())

Cela remplacera toutes les valeurs NaN dans **cov\_matrix** par la moyenne de chaque colonne correspondante.

Après avoir effectué cette imputation, vous pouvez réessayer de vérifier si la matrice variance-covariance est définie positive.