

Modélisation avancée des risques - Risques de marché et de crédit

Risques extrêmes

- Value-at-Risk : fondements et premières formalisations
- Value-at-Risk et Théorie des Valeurs Extrêmes

Risques multiples 1

- Définition et propriétés des copules
- Mise en œuvre des copules

Risques multiples 2

- Modélisation de la probabilité de défaut
- Modélisation du taux de recouvrement
- Modélisation stochastique et calibration
- Modélisation de la dépendance des défauts

CreditVaR

VALIDATION DES ACQUIS PAR QUIZ