



Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques

 **Télécharger**

 **Lire En Ligne**

[Click here](#) if your download doesn't start automatically

Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques

Yann Braouezec, Jérôme Brun

Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques Yann Braouezec, Jérôme Brun

Titre: Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques Auteur(s): Jérôme Brun et Yann Braouezec Editeur: La Revue Banque Année d'édition: 2007 Etat: Occasion - Bon ISBN : 9782863254653 Commentaire: Ancien livre de bibliothèque. Edition 2007. Ammareal reverse jusqu'à 15% du prix net de ce livre à des organisations caritatives. Chez Ammareal nous vendons des livres d'occasion en ligne fournis par nos partenaires bibliothèques et associations. Nous reversons une part du prix de chaque livre à nos partenaires et à des organisations caritatives. Ce que nous ne vendons pas nous le donnons, ce que nous ne donnons pas nous le recyclons.

 [Télécharger Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produi ...pdf](#)

 [Lire en ligne Dérivés de crédit vanille et exotiques : Prod ...pdf](#)

Téléchargez et lisez en ligne Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques Yann Braouezec, Jérôme Brun

175 pages

Présentation de l'éditeur

Un investisseur qui souhaite prendre une position sur du risque de crédit peut acheter une obligation émise par une entreprise privée. Il va alors supporter le risque de crédit, c'est-à-dire le risque de perte lié au défaut de paiement de l'obligation, mais également le risque de variation des taux d'intérêt. Les produits dérivés de crédit vont permettre à l'investisseur de prendre une position acheteuse ou même vendeuse sur le seul risque de crédit sans avoir à supporter un autre risque de marché tel que le risque de taux. Plus généralement, les produits dérivés de crédit permettent le transfert du risque de perte lié au défaut de paiement d'un ou plusieurs émetteurs de dette vers une contrepartie vendeuse de protection qui est alors rémunérée pour supporter ce risque.

L'objectif et l'originalité de ce livre sont de présenter dans un format compact une description précise des dérivés de crédit vanille et exotiques (CDS, FTD, indices de crédit et dérivés, tranches de CDO bespoke) ainsi que leur marché, les modèles d'évaluation des dérivés de crédit et les algorithmes de calibration associés, quelques pistes prometteuses de la recherche la plus récente, une description pratique de la gestion des risques. Sans viser l'exhaustivité, les auteurs ont tenté d'adopter dans ce livre une démarche pédagogique en décrivant précisément les produits et les marchés, avant de présenter les modèles d'évaluation, progressive en allant du simple vers le complexe, pratique puisque proche du marché. Par exemple, les auteurs présentent le modèle gaussien à un facteur en détail parce qu'il joue dorénavant un rôle comparable au modèle de Black et Scholes pour les options sur actions.

Ce livre s'adresse aux étudiants en Master de mathématiques appliquées à la finance, de sciences économiques ou de gestion, ainsi qu'aux étudiants des écoles d'ingénieurs et de commerce. Il intéressera les chercheurs en finance de marché mais également les praticiens de la banque (front-office, middle-office, département des risques de marché ou de contrepartie). Biographie de l'auteur

Après un doctorat en sciences économiques et une expérience

de professeur visitant à l'Université de Virginia (USA), Yann BRAOUEZEC est actuellement professeur dans le Département Ingénierie Financière de l'École supérieure

d'ingénieurs Léonard de Vinci. Il est par ailleurs coanimateur des "Petits-déjeuners de la Finance", organisés par l'association Frontières en Finance. Diplômé de l'École Centrale Paris, Jérôme BRUN a débuté sa

carrière en recherche quantitative à la Société Générale. Après 4 ans de trading sur produits structurés de crédit chez JPMorgan à

Londres, il dirige actuellement l'équipe de recherche

quantitative sur les dérivés de crédit à la Société Générale.

Download and Read Online Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques Yann Braouezec, Jérôme Brun #VRK3DWUJBT5

Lire Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun pour ebook en ligne
Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun Téléchargement gratuit de PDF, livres audio, livres à lire, bons livres à lire, livres bon marché, bons livres, livres en ligne, livres en ligne, revues de livres epub, lecture de livres en ligne, livres à lire en ligne, bibliothèque en ligne, bons livres à lire, PDF Les meilleurs livres à lire, les meilleurs livres pour lire les livres
Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun à lire en ligne.
Online Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun ebook
Téléchargement PDF
Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun Doc
Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun Mobipocket
Dérivés de crédit vanille et exotiques : Produits, modèles et gestion des risques par Yann Braouezec, Jérôme Brun Epub

VRK3DWUJBT5VRK3DWUJBT5VRK3DWUJBT5