



Genevieve Girard

**Modélisation du risque
financier par la TEV et les
copules**

Modélisation du risque financier par la TEV et les copules

 **Télécharger**

 **Lire En Ligne**

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

Modélisation du risque financier par la TEV et les copules

Guei Cyrille Okou

Modélisation du risque financier par la TEV et les copules Guei Cyrille Okou

 [Télécharger Modélisation du risque financier par la TEV et le ...pdf](#)

 [Lire en ligne Modélisation du risque financier par la TEV et ...pdf](#)

Téléchargez et lisez en ligne Modélisation du risque financier par la TEV et les copules Guei Cyrille Okou

120 pages

Présentation de l'éditeur

La théorie des valeurs extrêmes (TVE) occupe, depuis plusieurs années, une place privilégiée dans la recherche statistique pour la gestion des risques. Cette thèse contribue au développement de cet axe de recherche par l'introduction de nouveaux outils d'analyse et de décision ou par l'adaptation d'outils existant. Notre travail est divisé en quatre grandes parties. Dans la première partie, nous nous intéressons aux fondements de la théorie des valeurs extrêmes (TVE), en mettant l'accent sur l'approche de Peaks-Over-Threshold (POT). La deuxième partie concerne l'application de la TVE pour la gestion du risque financier. Cette application a permis de développer des méthodes d'estimation du seuil optimal par l'approche de Peaks Over Threshold (POT). La troisième partie est réservée à la théorie des copules. Cette partie traite les techniques qu'offrent les copules pour analyser les variables multivariées. La quatrième partie a été consacrée à l'application des copules pour modéliser les variables macroéconomiques et les extrêmes des indices boursiers. Cette application aborde la modélisation de la dépendance entre variables aléatoires par les copules. Biographie de l'auteur

Okou Guéi Cyrille est Professeur Assistant en statistique à l'Université Jean Lorougnon Guédé de Daloa (Côte d'Ivoire). Il a soutenu son doctorat unique en statistique à la Faculté des Sciences de Rabat (Maroc, Mars 2014). Okou a participé à des travaux de recherches sur la modélisation de données statistiques, qui ont abouti à des publications.

Download and Read Online Modélisation du risque financier par la TEV et les copules Guei Cyrille Okou #QB4ESGT9DJ3

Lire Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou pour ebook en ligne Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou 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 Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou à lire en ligne. Online Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou ebook Téléchargement PDF Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou Doc Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou Mobipocket Modélisation du risque financier par la TEV et les copules par Guei Cyrille Okou EPub

QB4ESGT9DJ3QB4ESGT9DJ3QB4ESGT9DJ3