



Ordre de dispersion pour des lois conditionnelles archimédiennes

By Loukrati, Hicham

Condition: New. Publisher/Verlag: Éditions universitaires européennes | Avec application en finance | Les ordres stochastiques représentent des outils intéressants permettant de comparer deux variables aléatoires ou deux vecteurs aléatoires. Ils utilisent toute l'information sur la distribution afin d'établir une comparaison adéquate entre deux risques. Dans la littérature, nous retrouvons plusieurs types d'ordres stochastiques comme la dominance stochastique, les ordres convexes, l'ordre de dispersion. Ces inégalités stochastiques ont plusieurs applications en finance et en actuariat, par exemple la dominance stochastique est liée directement à la mesure de risque appelée valeur à risque et l'ordre convexe croissant (stop-loss), associées à des portefeuilles différents, permet d'analyser la VaR conditionnelle. Ce projet de recherche concerne l'étude de la variabilité d'un risque X_2 étant donné un risque X_1 ($X_2|X_1$). Plus spécifiquement, nous nous intéressons à examiner le comportement de la volatilité de X_2 lorsque X_1 augmente ou diminue. Nous analysons aussi la variabilité de $X_2|X_1$ lorsque la dépendance entre ces risques augmente. Ici, la dépendance est gérée par des copules archimédiennes. Ceci permet d'analyser l'impact de la corrélation sur la volatilité conditionnelle. | Format: Paperback | Language/Sprache: fr | 92 pp.



READ ONLINE

[2.6 MB]

Reviews

Most of these pdf is the best pdf offered. It can be rally fascinating throug studying period of time. You may like just how the writer write this pdf.
-- **Carlie Bahringer IV**

A very wonderful pdf with perfect and lucid explanations. This can be for those who statte that there had not been a worth reading. Once you begin to read the book, it is extremely difficult to leave it before concluding.
-- **Mr. Stone Kunze**