

Gestion des risques de crédit : Théorie et applications

Franck MORAUX

1 Introduction Générale (contexte, définitions, notation, typologie, etc).

THEORIE

2: Modèles de l'approche de forme réduite

3: Modèles de l'approche structurelle

APPLICATIONS

4: Dérivés de crédit à sous-jacent unique

5: Dérivés de crédit à sous-jacents multiples

APPROFONDISSEMENT

6: Modélisation des obligations complexes (titres hybrides, titres assortis de clause(s) optionnelle(s)).

7: Modélisation des procédures (de sauvegarde, de liquidation, de négociation).