



## Mesure de Risque & Risque de Crédit

Conférencier: Ahmed Kebaïer de l'Université Paris 13.

le 7-8-9 juillet : 9h - 12h  
à la salle Chaire Unesco-ENIT/LAMSIN -Tour Osman Bahri.

### **Descriptif du cours:**

Répondant à un besoin de protection contre le risque de crédit, le marché des dérivés de crédit et particulièrement celui des tranches de CDO (Collateralized Debt Obligation) a connu une croissance fulgurante au cours des dernières années. La récente crise des subprimes (2007) aura bouleversé la perception des risques sur le marché des tranches de CDO et ses conséquences auront particulièrement mis en évidence les limites des pratiques actuelles en termes de gestion des risques et de couverture. Ainsi, la couverture et la gestion des risques des tranches de CDO et des produits associés sont en passe de devenir les sujets de préoccupation majeure du moment.

Le but de ce cours est de présenter, dans une première partie théorique, les outils de mesure des risques concernant la gestion du portefeuille d'actifs pour une échelle de temps courte. La deuxième partie sera consacrée à la présentation, modélisation et pricing des CDO dans la salle de marché. Les principaux thèmes théoriques seront : la théorie des valeurs extrêmes, les mesures de risque monétaires et la représentation multidimensionnelle des risques via les copules.

N.B: Pour confirmer votre présence, il suffit d'envoyer un email à Hanen Mezghani (adresse: hanen\_mezghanni@yahoo.fr)