



## Les fonctions copules en finance

Cécile Kharoubi-Rakotomalala

 Télécharger

 Lire En Ligne

Les fonctions copules en finance Cécile Kharoubi-Rakotomalala

 [Download Les fonctions copules en finance ...pdf](#)

 [Read Online Les fonctions copules en finance ...pdf](#)

# **Les fonctions copules en finance**

*Cécile Kharoubi-Rakotomalala*

**Les fonctions copules en finance** Cécile Kharoubi-Rakotomalala

## **Téléchargez et lisez en ligne Les fonctions copules en finance Cécile Kharoubi-Rakotomalala**

---

148 pages

Présentation de l'éditeur

Depuis quelques années, la recherche financière s'inscrit dans une nouvelle dynamique. La nécessité de mieux modéliser le comportement des rendements des actifs financiers et les risques sur les marchés pousse les chercheurs à emprunter des méthodes et des outils à d'autres disciplines scientifiques comme la biologie, la physique, ou les statistiques. Ces méthodes permettent de mieux expliquer, appréhender et prévoir les évolutions futures des cours boursiers. Cet ouvrage se situe dans cette évolution ; ayant admis la non-normalité des rendements univariés, l'auteur présente des mesures de dépendance alternatives au coefficient de corrélation linéaire afin de modéliser les comouvements des marchés financiers. Après avoir présenté cette nouvelle méthodologie, trois études empiriques sont conduites. Les marchés des indices internationaux d'actions ainsi que les hedge funds sont aussi examinés dans le but d'étudier l'impact de la structure de dépendance sur la gestion des risques et la diversification. Enfin, cet ouvrage propose une étude des déterminants de l'évolution du degré de dépendance afin d'identifier ce qui permettrait d'expliquer les variations des comouvements des marchés. Biographie de l'auteur

Docteur en sciences de gestion de l'université Paris-Dauphine et de l'ESSEC, Cécile Kharoubi-Rahotomalala est professeur de finance de marché à ESCP-EAP Ses travaux portent sur la modélisation de la dépendance des marchés actions, la gestion des risques et les hedge funds.

Download and Read Online Les fonctions copules en finance Cécile Kharoubi-Rakotomalala

#E3XI741U0QL

Lire Les fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala pour ebook en ligneLes fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala 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 Les fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala à lire en ligne.Online Les fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala ebook Téléchargement PDFLes fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala DocLes fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala MobipocketLes fonctions copules en finance par Cécile Kharoubi-Rakotomalala EPub

**E3XI741U0QLE3XI741U0QLE3XI741U0QL**