

CERGY 2017-2018

RISQUES AVANCES

Numéro/Nom/ Prénom: /..... //.....

Présentez les résultats en Euro avec 2 décimales et les autres résultats avec 4 chiffres significatifs en utilisant éventuellement une notation scientifique (2,15 E-08)

1 – STATISTIQUES

1-01 Contrevaleur en Euro du Portefeuille au 2 janvier 2014	
1-02 Résultat du portefeuille en euro entre le 02 01 2014 et le 30 12 2016	
1-03 Risque Forfaitaire 2% au 30 12 2016	

2 – CALCUL MATRICIEL FINANCIER

2-01 Ecart type devise 4	
2-02 Corrélation entre devise 4 et devise 5	
2-03 Trace de la matrice de Cholesky	

2-04 Valeurs Propres (ordre décroissant)					
2-05 Vecteur Propre de la plus grande valeur propre					

3 et 4 - CALCUL DE LA VAR

METHODE :	3-HISTORIQUE	4-PARAMETRIQUE
1-VAR sur la devise 2 – GBP		
2-VAR sur la devise 4		
3-VAR sur le portefeuille dev4+dev5 sans corrélation	ne pas répondre	
4-VAR sur le portefeuille dev4+dev5 avec corrélations		
5-VAR sur le portefeuille avec toutes les corrélations nulles	Ne pas répondre	
6-VAR sur le portefeuille		
7-Expected Shortfall sur le portefeuille		

5 – CALCUL DU GRADIENT DE LA VAR COMPONENT ET MARGINALE

	Gradient	Var Component VARC	Var Marginale VARM Analytique	Var Marginale VAR Simulations
USD				
GBP				
CHF				
DEV 4				
DEV 5				

6 – CALCUL EN ANALYSE EN COMPOSANTE PRINCIPALE (ACP)

	Projection du Portefeuille	VAR sur chaque Axe de projection
Facteur 01		
Facteur 02		
Facteur 03		
Facteur 04		
Facteur 05		

	Var progressive
Facteur 01	
Facteurs 01 à 02	
Facteurs 01 à 03	
Facteurs 01 à 04	
Facteurs 01 à 05	

7 et 8 – CALCUL DE LA VAR MONTE CARLO

METHODE	6-MONTE CARLO- Cholesky	7-MONTE CARLO- Racine Carrée
1-VAR sur la devise 1 – USD		
2-VAR sur le portefeuille dev4		
3-VAR sur le portefeuille dev4+dev5		
4-VAR sur le portefeuille		
5-Expected Shortfall sur le portefeuille		
6-VAR Historique sur le portefeuille avec la méthode antithétique		

9 – VAR MINIMALE :

VAR minimale :

Var minimale	Portefeuille	Gradient	VARC	VARM	Projections
USD					
GBP					
CHF					
DEV 4					
DEV 5					

FIN DE L'EXERCICE.

-/-/-