

Modélisation stochastique du risque de crédit

ECTS : 2

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

Le modèle de Merton, les modèles à intensité.

Compétence à acquérir :

Comprendre et savoir implémenter en Python, les principaux modèles de la littérature.

Mode de contrôle des connaissances :

CC (30%) + Examen final (70%)

Bibliographie, lectures recommandées :

Cours auto-suffisant.

Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16