



2ÈME ANNÉE ENSAE

RAPPORT DE STAGE DE 2A

MENTION CONFIDENTIEL

Modélisation des risques climatiques pour les institutions financières.

Samy Mekkaoui

Sous la Supervision de Monsieur Hakim Ameziani

Année Universitaire 2021-2022

Sommaire

1	Introduction	2
2	Mise en place des données	3
3	Quels biais associés à une vision agrégée des 3 piliers ?	4
4	Prise en compte de la contrainte ESG dans la théorie du portefeuille efficient de Markowitz	5
5	Quelle importance accorder à la dispersion des notations ?	6
6	Conclusion	7
7	Références	8
8	Note de synthèse	9

1 Introduction

2 Mise en place des données

3 Quels biais associés à une vision agrégée des 3 piliers ?

Insérer Article

4 Prise en compte de la contrainte ESG dans la théorie du portefeuille efficient de Markowitz

Ajouter les résultats obtenus du précédent rapport

5 Quelle importance accorder à la dispersion des notations ?

Insérer Article

6 Conclusion

7 Références

8 Note de synthèse