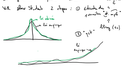
Notion : fonction (f°)
moyenne (moy (X))

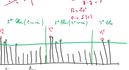
POT : Abs Tx ≥ 0 fonction
Hazard
Abs ≤ moy ≤ moyenne

VaR Historique : quantile sur R
VaR paramétrique : quantile —
VaR Monte Carlo : 2 étapes : ① calculer la quantile q^{α}
② $\mathbb{P}(X \leq q^{\alpha}) = \alpha$



2 pts clés à calculer chaque :
① Pour VaR param
② calculer la moyenne

POT : MLE (Maximum Likelihood Estimation)
Hill (Hill Estimator)



Cas : 1° $\mathbb{P}(X \leq x) = 1 - \frac{1}{x^{\alpha}}$ 2° $\mathbb{P}(X \leq x) = 1 - \frac{1}{x^{\alpha}} + \frac{1}{x^{\alpha}}$ 3° VaR