
Nonlinear Monte Carlo schemes for counterparty risk on credit derivatives

Tuyet Mai Nguyen^{*1} and Stéphane Crepey¹

¹Département de Mathématiques [Evry] – Université d'Evry-Val d'Essonne – Bâtiment I.B.G.B.I., 3ème étage, 23 Bd. de France, 91037 EVRY CEDEX, France

Abstract

^{*}Speaker