

Enseignants:	Henrard Luc ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables :	-- Théorie des portefeuilles, -- notions de base de statistiques, -- probabilités, -- marchés et instruments financiers.
Thèmes abordés :	Deux thèmes principaux sont abordés : -- comment les Institutions financières quantifient et gèrent leurs risques (une attention particulière sera donnée au Capital Economique, au RARORAC et a l' EVA avec un focus sur les risques de Crédit et Contrepartie, le risque ALM, le risque de Trading, le risque Opérationnel et la Titrisation) -- l'impact des nouvelles réglementations sur l'appétit au risque, le modèle bancaire et la gouvernance de ces Institutions.
Acquis d'apprentissage	-- maîtriser des savoirs (appliquer ses savoirs à bon escient face à un problème) -- appliquer une démarche scientifique (penser le problème selon une approche systémique et globale) -- travailler en équipe (s'intégrer et être capable de collaborer au sein d'une équipe). Ces acquis s'apprendront via une série de workshops et d'interactions avec le Professeur durant le cours. <i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i>
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	-- via un examen écrit (70 % des points) -- via 3 workshops à résoudre en groupe (30 % des points)
Méthodes d'enseignement :	-- présentation orale des workshops avec session de « questions/réponses » -- interactions avec le Professeur durant les cours -- débat en classe sur des sujets d'actualité -- apprentissage par projet -- étude chez soi
Contenu :	Le cours propose une approche économique de la performance basée sur le "risk adjusted return on risk adjusted capital" (RARORAC) et le "economic value added" (EVA) . Les notions d'Expected loss, Unexpected Loss, Value at Risk, Fair Value et Economic/Regulatory Capital seront développées . Les étudiants devront également faire des études de cas liées à la gestion des risques.
Bibliographie :	-- Support de cours (livres et articles disponibles à la bibliothèque ou sur internet. -- Syllabus disponible sur Moodle -- Lectures conseillées : "Risk Management in Banking" de Joel Bessis (John Wiley and Sons, Ltd) - "Risk Management and Financial Institutions" de John Hull (Pearson)

Faculté ou entité en charge:	CLSM
------------------------------	------

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [120] en ingénieur de gestion	INGE2M	5	-	
Master [120] en sciences de gestion	GEST2M	5	-	
Master [120] en sciences de gestion	GESM2M	5	-	
Master [120] en ingénieur de gestion	INGM2M	5	-	