

5.0 crédits	30.0 h	2q
-------------	--------	----

Enseignants:	Henrard Luc ; Grégoire Philippe ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Thèmes abordés :	Deux thèmes principaux sont abordés ; le premier se concentre sur la lecture et l'analyse des états financiers d'une banque. Le deuxième thème couvre la problématique de la mesure et de la gestion des risques de taux d'intérêt et des risques de crédit associés à l'activité bancaire.
Acquis d'apprentissage	L'étudiant(e) doit être capable de comprendre les états financiers d'une banque et d'en mesurer les risques et la performance. Une attention particulière est donnée à la gestion des risques de taux d'intérêt et de crédit. <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>
Contenu :	<p>Les rubriques de l'actif et du passif sont exposées et analysées. Une attention particulière est donnée au lien existant entre le bilan et le compte de résultats de la banque. Les principaux ratios de performance sont analysés. La deuxième partie du cours propose une approche économique de la performance basée sur des calculs de RAROC et VaR. Les notions d'Expected Loss et d'Unexpected Loss sont introduites dans le cadre de la gestion du risque crédit. Le cours repose sur un exposé magistral et sur l'analyse d'un business case.</p> <p>Contenu</p> <ul style="list-style-type: none"> Rubriques de l'actif et du passif Eléments hors bilan Compte de résultats Analyse de la performance Capital économique Rentabilité ajustée au risque (RAROC, RORAC) Risque de taux Risque Crédit Asset Liability Management <p>Méthodes</p> <ul style="list-style-type: none"> Activités en présentiel 1 Exposés magistraux 1 Apprentissage par projet Activités hors présentiel 1 Rédaction de travaux
Autres infos :	<p>Pré-requis (idéalement en termes de compétences) : Théorie de portefeuille, éléments de calcul statistique et de probabilité.</p> <p>Evaluation : L'évaluation repose pour 1/3 des points sur la réalisation d'un travail sur des données réelles. L'examen est écrit et entre pour 2/3 des points dans la note finale.</p> <p>Support : Livres disponibles à la bibliothèques, articles de revues scientifiques et transparents disponibles sur i-campus.</p> <p>Références :</p> <p>Fournies durant le cours</p> <p>Encadrement : Professeur et assistant</p> <p>Autres :</p> <p>Eléments d'internationalisation 1 contenu international (le cours aborde-t-il les problématiques internationales liées au contenu ?)</p> <p>Interventions d'entreprises 1 intervenant du monde de l'entreprise</p> <p>Compétences transversales 1 travail de groupe</p>

<p>Cycle et année d'étude: :</p>	<p>> Master [120] en ingénieur de gestion > Master [120] en sciences de gestion</p>
<p>Faculté ou entité en charge:</p>	<p>CLSM</p>