

5.0 crédits

30.0 h

2q

Enseignants:	Henrard Luc ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Thèmes abordés :	Le cours aborde la réglementation bancaire sur le niveau de capital nécessaire pour supporter les risques de crédit et les risques de marché. Le capital économique et l'allocation de capital économique en vue de mesurer la rentabilité des business units feront l'objet d'une étude détaillée.
Acquis d'apprentissage	L'étudiant(e) doit être capable de réaliser une analyse des risques actifs - passifs de la banque et de déterminer le niveau de capital économique nécessaire. <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>Une attention particulière est donnée à la détermination du capital économique. Les notions essentielles de pertes attendues et inattendues sont abordées dans le cadre d'une étude de cas basée sur une expérience réelle.</p> <p>Contenu Réglementation : Basle II Capital économique Risque de crédit : Loss Given Default, Expected Loss, Unexepected Loss Risque de marché: Value at Risk Risque ALM (Asset Liability Management)</p> <p>Méthodes Activités en présentiel 1 Séminaire interactif 1 Apprentissage par projet Activités hors présentiel 1 Lectures préparatoires 1 Rédaction de travaux 1 Préparation de présentations</p>
Autres infos :	<p>Pré-requis (idéalement en termes de compétences) : Théorie de portefeuille, éléments de calcul statistique et de probabilité, Introduction au management bancaire.</p> <p>Evaluation : L'évaluation repose la participation des étudiants au séminaire, sur leur présentation intermédiaire et finale de l'étude de cas..</p> <p>Support : Livres disponibles à la bibliothèques, articles de revues scientifiques et transparents disponibles sur i-campus.</p> <p>Références : 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 étude de cas 1 intervenant du monde de l'entreprise</p> <p>Compétences transversales 1 présentation orale 1 travail de groupe</p>
Cycle et année d'étude: :	<p>> Master [120] en ingénieur de gestion > Master [120] en sciences de gestion</p>

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