

3.0 crédits

15.0 h

Enseignants:	Hafner Christian ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables :	Cours de base en statistique (par ex. INGE1214) et en finance quantitative
Thèmes abordés :	Analyse de différents types de risque sur les marchés financiers et alternatifs
Acquis d'apprentissage	Capacité à l'évaluation quantitative des risques <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 :	Etudes de cas (20%) et examen oral (80%)
Méthodes d'enseignement :	Plusieurs études de cas pratiques, à résoudre sur ordinateur, sont utilisées pour guider l'étudiant dans la matière. Ces études de cas sont évaluées.
Contenu :	Ce cours vise à présenter à l'étudiant la méthodologie suivie en analyse quantitative du risque. Les sujets abordés couvrent les concepts de base en risk management, les mesures de risque, les modèles multivariés, les séries temporelles financières et les mesures de dépendance. Le cours se concentre sur les aspects statistiques et de mise en pratique des techniques présentées.
Bibliographie :	« Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques, and Tools » (2005) Alexander J. McNeil, Rüdiger Frey, and Paul Embrechts, Princeton Series in Finance.
Cycle et année d'étude: :	<a href="#">&gt; Master [120] en sciences actuarielles</a> <a href="#">&gt; Master [120] en statistiques, orientation générale</a>
Faculté ou entité en charge:	LSBA