LECON2331

2015-2016

Economics of Finance and Risk Management

5.0 crédits	30.0 h	2q

Enseignants:	Giot Pierre ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Namur
Thèmes abordés :	Ce cours porte sur la modélisation des taux d'intérêt et des risques du crédit avec un accent particulier sur les théories de courbe de rendement, les simulations de Monte Carlo et les approches fondées sur la segmentation. En ce qui concerne la modélisation des risques du crédit, nous nous concentrons sur les modèles d'estimation, les modèles de production-distribution.
Acquis d'apprentissage	avoir une bonne compréhension de la modélisation des taux d'intérêt (y compris la modélisation des taux d'intérêt en incertitude) et des modèles des crédit à risque *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) ».*
Contenu :	Contenu : - théories des courbes de rendements, - modèles de simulations de Monte Carlo - approches par segmentation pour modéliser les taux d'intérêt en incertitude - modèles des risques liés au crédit (estimation, rendement, ...)
Autres infos :	Le cours fait référence principalement à deux livres : The course is mainly based on two book : 1) Santomero & Babbel : Financial Markets, Instruments & Institutions 2) Johnson : Bond evaluation, selection and management Examen écrit à la fin du cours
Faculté ou entité en charge:	ECON

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)

Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [60] en sciences économiques, orientation générale	ECON2M1	5	-	
Master [120] en sciences économiques, orientation générale	ECON2M	5	-	