UCL Université catholique de Louvain

LLSMS2019

2015-2016

Risk Management of Financial Institutions (Part 1)

5.0 crédits	30.0 h	2q

Enseignants:	Henrard Luc ;
Langue d'enseignement:	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables :	Théorie de portefeuille, éléments de calcul statistique et de probabilité.
Thèmes abordés :	Deux thèmes principaux sont abordés : 1) comment les Institutions Financières quantifient et gèrent leurs risques 2) l impact de la crise 2008 des subprimes sur le profil de risque et la gouvernance d entreprise des grands banques dans le monde
Acquis d'apprentissage	Eu égard au référentiel des acquis d'apprentissage AA du programme, cette activité contribue au développement et à l'acquisition des AA suivants: -- 1. Agir en acteur socialement responsable 1.1. 'porter un regard critique et réflexif ' 1.2. Décider et agir en intégrant des valeurs éthiques, humanistes ,' 1.3. Décider et agir de manière responsable ' 2. Maîtrise des savoirs 2.1. Maîtriser un socle de savoirs ' 2.2. Maîtriser des savoirs hautement spécialisés ' 2.3. Articuler des savoirs issus de différents domaines 2.4. Activer et appliquer des savoirs' 3. Appliquer une démarche scientifique 3.1. Mener un raisonnement analytique' 3.4. Synthétiser avec discernement ' faire preuve d'abstraction conceptuelle ' 5. Agir en contexte multiculturel et international 5.1. Comprendre le fonctionnement interne d'une entreprise' 5.2. Situer ' ce fonctionnement dans son contexte socio-économique' 6. Travailler en équipe et en exercer le leadership 6.1. Travailler en équipe... 8. Communiquer 8.1. Exprimer un message de façon claire et structurée' *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) ».*
Modes d'évaluation des acquis des étudiants :	L évaluation repose pour 25 % des points sur la réalisation de travaux en groupe. L examen écrit compte pour 75 % des points dans la note finale.
Méthodes d'enseignement :	Activités en présentiel 1 Exposés magistraux 1 Apprentissage par projet Activités hors présentiel 1 Rédaction de travaux
Contenu :	Le cours propose une approche économique du risque et de la performance basée sur les concepts de Capital Economique, Expected Loss, Unexpected Loss, Value at Risk, RARORAC et EVA. Le cours repose sur un exposé magistral et sur l analyse de plusieurs business cases. Contenu definition du risque Capital économique Rentabilité ajustée au risque (RAROC, RORAC,RARORAC) focus sur le Risque Crédit Titrisation (MBS,ABS, CDO,CDO Squared)
Bibliographie :	: et disponible en ligne DIAPORAMA obligatoire et disponible en ligne . OUVRAGE proposé : Risk Management in Banking -third edition - Joel Bessis (John Wiley and Sons,LTD) non obligatoire. Les supports disponibles en ligne sont sur ICAMPUS.

Autres infos :	Pré-requis (idéalement en termes de compétences) : Théorie de portefeuille, éléments de calcul statistique et de probabilité. 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. Support : Livres disponibles à la bibliothèques, articles de revues scientifiques et transparents disponibles sur i-campus. Références : Fournies durant le cours Encadrement : Professeur et assistant Autres : Eléments d'internationalisation 1 contenu international (le cours aborde-t-il les problématiques internationales liées au contenu ?) Interventions d'entreprises 1 intervenant du monde de l'entreprise Compétences transversales 1 travail de groupe
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 sciences de gestion	GEST2M	5	-	
Master [120] ingénieur de gestion	INGM2M	5	-	
Master [120] en ingénieur de gestion	INGE2M	5	-	
Master [120] en sciences de gestion	GESM2M	5	-	