


5.00 crédits	30.0 h	Q2
--------------	--------	----

Enseignants	Van Wynendaele Pascal ;
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	A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de : 1 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
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Examen classique écrit d'une durée de 2h mixant des questions à choix multiples et questions ouvertes. Course dispensé à l'UNamur (Namur)
Méthodes d'enseignement	Ex Cathedra Pas de travail.
Contenu	Le cours se focalise essentiellement sur les aspects Business model de la banque et le process de gestion des risques qui répond de plus en plus à des contraintes réglementaires. Le cours aborde plus particulièrement : - Le rôle des banques dans le système financier et leur business model - Les principes majeurs de la gestion des risques et la notion de risque - La défaillance des systèmes de gestion des risques durant les crises financières de 2007 et 2011 - L'évolution de la réglementation bancaire : de Bâle 1 à Bâle 4 et le framework contrôle prudentiel mis en place par les autorités européennes - La gestion du risque de crédit (PD, LGD, EaD, M et RWA), du risque de marché (Value at Risk et Expected Shortfall) et du risque de liquidité (LCR et NSFR)
Bibliographie	Risk Management and Financial Institutions, 5th Edition, John Hull, 2018 (Wiley) Santomero & Babbel: Financial markets, instruments and institutions (McGraw-Hill). Johnson
Autres infos	Objectifs : Cours avancé d'économie de la finance de la perspective de la gestion des risques visant à discuter principalement de la notion de risque et des recents développements de la réglementation bancaire dans un conxte post crise financière.
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		