





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

Enseignants	Lassance Nathan ;
Langue d'enseignement	Anglais
Lieu du cours	Mons
Préalables	MGEST1219 Finance
Thèmes abordés	Le cours présente, analyse et quantifie les risques gérés par les institutions financières. Au terme de ce cours, l'étudiant aura une connaissance des principales institutions financières et de la régulation qui s'y rapporte, ainsi que de la manière dont sont gérés les risques de marché, de crédit, de liquidité ou opérationnel au sein de ces institutions.
Acquis d'apprentissage	<p>A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de :</p> <p>A la fin de ce cours, les étudiants seront capable de :</p> <ol style="list-style-type: none"> • Identifier et décrire les principaux risques supportés par les institutions financières (banques, compagnies d'assurance et fonds de pension, fonds mutuels) • D'expliquer la relation rendement-risque dans le cadre d'une institution financière et la façon dont les institutions financières tirent profit de la prise et de la gestion de risque. • D'identifier les techniques utilisées par les banques pour mesurer et gérer les risques (de crédit, de marché, opérationnel, de liquidité) • D'expliquer le cadre de la régulation prudentielle du secteur financier et son effet sur la prise de risque des institutions financières
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Examen écrit en session (80%) + travail de groupe (20%)
Méthodes d'enseignement	<ul style="list-style-type: none"> • Cours magistral • Travail de groupe
Contenu	<p>Contenu des cours magistraux (en anglais):</p> <ul style="list-style-type: none"> • Partie 1: Introduction, Financial Institutions and Trading in Financial Markets • Partie 2: Market Risk – Volatility, Dependence, Value-at-Risk, Expected Shortfall • Partie 3: Basel Regulation and Credit Risk <p>Le travail de groupe se compose d'exercices théoriques et pratiques qui appliquent les différents concepts couverts en cours.</p>
Ressources en ligne	Student corner
Bibliographie	John C. Hull, Risk Management and Financial Institutions (5th edition), Wiley, 2018
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	GESM2M	5		
Master [120] en gestion de l'entreprise	GENT2M	5		
Master [120] : ingénieur de gestion	INGE2M	5		
Master [120] en sciences de gestion	GEST2M	5		
Master [120] : ingénieur de gestion	INGM2M	5		