Méthodologie en gestion globale des Risques : VAR

ECTS : 3

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

1. Introduction et définition de la Value at Risk
2. Méthodes et méthodologies de calcul
3. Choix de distribution de probabilité pour positions optionnelles
4. Mesure de risque de marché et RiskMetrics
5. Risque de crédit et exigences réglementaires
6. Risque de corrélation défavorable, liquidité et xVA
7. Expected Shortfall et VaR sur Valeurs extrêmes

Compétence à acquérir :

Clarifier la notion de risque et présenter les principales techniques et méthodes de VaR permettant de mesurer, analyser et prédire le risque.
Le risque de marché fera l'objet d''une attention particulière au travers de l'analyse de la VaR. Les méthodes de gestion globale du risque de marché lorsque les sources d'incertitudes sont multiples seront également étudiées.