Gestion globale des risques : VAR

ECTS : 2

Volume horaire : 21

Description du contenu de l'enseignement :

Mesures de risque et régulation (Solvency, Bale): exemple de calculs. Modèles dynamiques pour les prix d'actifs financiers. Agrégation des risques de manière très générale, c'est à dire pour différents types de risque sur des exemples, aussi bien en assurance qu'en finance. Risques des produits dérivés également. Modèles multivariés. Implémentation en Python.

Compétence à acquérir :

Analyse des modèles mathématiques du risque de marché, étude des méthodes de gestion globales du risque de marché lorsque les sources d'incertitude sont multiples.

Mode de contrôle des connaissances :

0.3*CC+0.7*E avec E=examen sur table et CC=contrôle continu.

Bibliographie, lectures recommandées :

Ce cous est "self-content" mais ne pas hésiter à combler ses lacunes en lisant un cours de calcul stochastique+EDS et discretisation Euler.