Gestion des Risques

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

•Construction de courbe de taux et de nappes de volatilités

•Valorisation des produits vanilles(Swap, IRG, …)

•Introduction au calcul des sensibilités de taux

•Définition des différents type de risque (Risque absolue (absolute risk) , risque relatif(Relative risk), Basis risk, Volatility risk)

•Risque de position et calcul des greecs des produits dérivés (delta, gamma, vega, theta, rho,..)

•Calcul des indicateurs de risque de marché des produits de taux (Duration, sensibilité aux différents facteurs de risque)

•Introduction au calcul de la VAR

• *VAR Historique, VAR paramétrique ,VAR Monte-Carlo*

Compétence à acquérir :

Acquérir les principes de base de la construction des courbes de taux et des données de marché en général, maîtriser la valorisation des produits financiers vanille et calculer les indicateurs de suivi et de gestion des risques d'un portefeuille donné.