

Mesures de risque de marché : théorie et évaluation

Infos pratiques

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 24.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français, Anglais
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > En savoir plus : <https://sites.google.com/view/mastergda>

Présentation

L'objectif de ce séminaire est de permettre aux étudiants de se familiariser avec les mesures de risque de marché, notamment la Value-at-Risk et l'Expected Shortfall, d'approfondir les méthodes économétriques de calcul de ces mesures ainsi que les tests statistiques qui permettent d'analyser la validité de telles mesures.

Calendrier :

- 1 séance – début septembre – type cours introductif (voir cours en ligne)
- Séances restantes : suivi du travail individuel des étudiants

Ces séances visent à accompagner l'étudiant dans la compréhension et la présentation d'un papier de recherche qu'il aura sélectionné parmi une liste d'article au choix. La présentation se fera à l'aide d'un support visuel, durera 15 à 20 minutes et devra démontrer la compréhension du travail de recherche analysé et proposer un regard critique sur les résultats et les conclusions.

Objectifs

Ce cours vise à accompagner l'étudiant dans la compréhension et la présentation d'un papier de

recherche qu'il aura sélectionné parmi une liste d'articles au choix. La présentation se fera à l'aide d'un support visuel, durera 15 à 20 minutes et devra démontrer la compréhension du travail de recherche analysé et proposer un regard critique sur les résultats et les conclusions.

Évaluation

Évaluation d'un mini mémoire

Pré-requis nécessaires

Le cours exige un niveau M1 en probabilités, statistiques, économétrie et en finance

Compétences visées

Lire, comprendre et retranscrire un article de recherche portant sur des concepts avancés de mesure du risque

Bibliographie

Divers articles de recherche mis à jour régulièrement au fil des années

Ressources pédagogiques

Classe interactive