

# 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