Mesures de risques de marché

Infos pratiques

> **ECTS** : 4.5
> **Nombre d'heures** : 24.0
> **Langue(s) d'enseignement** : Français
> **Niveau d'étude** : BAC +5
> **Période de l'année** : Enseignement neuvième semestre
> **Méthodes d'enseignement** : En présence
> **Forme d'enseignement** : Cours magistral
> **Ouvert aux étudiants en échange** : Oui
> **Campus** : Campus de Nanterre
> **Composante** : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
> **Code ELP** : 5E9GMMRM
> **En savoir plus** : Site du master GAMR 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.

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

Modalités : CCI
SESSION UNIQUE :
Contrôle Continu
• Type : Oral, Dossier
• Durée : Oral de 30 minutes environ
• Précisions : Oral + mémoire
Régime Dérogatoire
• Type : Dossier
• Durée : Mémoire
• Précisions : Mémoire

RATTRAPAGES :
• Type : Dossier
• Durée : Mémoire
• Précisions : Mémoire

Utilisation de l'intelligence artificielle :
Dans le cadre de cet EC, l'usage de l'IA pour aider à la réalisation des travaux soumis à évaluation

- *est autorisé pour les tâches suivantes :*
  - documentation (identification de ressources pertinentes, synthèse de travaux existants, état de l'art)
  - recherche d'idées (explicitation du sujet, "brainstorming")
  - édition (correction de fautes d'orthographe et de syntaxe, mise en forme des références, traduction de citations et d'extraits).
  - Code
- *Il est interdit pour les tâches suivantes :*
  - construction (problématisation, suggestion de plan)
  - rédaction (amélioration du style, réécriture de passages, rédaction de résumés)

Les résultats fournis par l'IA doivent constituer un matériau pour votre réflexion, et toujours faire l'objet d'une réappropriation et d'une reprise critique.
Tous les usages doivent être documentés dans une section dédiée à la fin de votre travail, à l'exception des usages de

recherche web augmentée, de correction orthographique et syntaxique. Cette section doit permettre à votre lecteur d'évaluer la manière dont vous avez travaillé avec l'IA et mobilisé cette ressource au service d'un travail personnel. L'intégration directe de contenus engendrés par l'IA doit être faite sous le régime de la citation.

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.
- Mettre en place une stratégie de calcul de la VaR.

Bibliographie

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

Ressources pédagogiques

Classe interactive

Contact(s)

> Thomas Chuffart

Responsable pédagogique
tchuffart@parisnanterre.fr