

PLAN

Chapitre 1 : LE RISQUE ET LA GESTION DES RISQUES

- I- Définition du risque et de la gestion des risques
 - 1- Le risque
 - 2- La gestion des risques : Définition et historique
- II- Les différents types de risques
 - 1- Les risques économiques
 - 2- les risques financiers
- III- Risques bancaires et normes prudentielles
 - 1- Les risques bancaires
 - 2- Enjeux des risques opérationnels
 - 3- Règlementations prudentielles : Les accords de Bâle

Chapitre 2 : LE RISQUE DE MARCHE : approche espérance - variance

- I- La notion de position :
- II- La notion risque / rendement
 - 1- Le risque d'un titre financier
 - 2- Risque et portefeuille de titres
 - 3- Introduction de l'actif sans risque
- III- Le MEDAF
- IV- Limites de l'écart-type en tant que mesure de risque

Chapitre 3 : LA VALUE AT RISK OU VaR : mesure du risque de marché

- I- Définition de la VaR
- II- Les méthodes d'estimation de la VaR
 - 1- La méthode paramétrique
 - 2- La méthode historique
 - 3- La méthode Monte Carlo
- III- Le Backtesting de la VaR
- IV- Les autres mesures de risque
 - 1- Expected shortfall
 - 2- Stress testing

Chapitre 4 : LES AUTRES RISQUES

- 1- Mesure du risque de crédit
- 2- Mesure du risque de liquidité
- 3- Mesure du risque opérationnel

Bibliographie :

-BERK Jonathan et DEMARZO Peter, 2008, *Finance d'Entreprise*, Edition Pearson Education

-HULL John, 2012, *Gestion des risques et Institutions Financières*, Edition Pearson

-RONCALLI Thierry, 2004, *La gestion des risques financiers*, Edition Economica

-SIMON Yves, 1997, *Encyclopédie des marchés financiers*, Edition Economica

-VAN GREUNING Hennie, BRAJOVIC BRATANOVIC Sonja, 2004, *Analyse et gestion du risqué bancaire*, Edition ESKA

-VERNIMMEN Pierre, 2014, *Finance d'Entreprise*, Edition Dalloz