

**Gestion des Risques: 14 h****Objectifs :**

Ce module a pour double objectif :

- familiariser le public avec les outils conceptuels de gestion des risques : Value at risk, Méthode DEA (Data Envelopment Analysis), Allocation de fonds Propres, Evaluation des risques (crédit, marché, opérationnel) ;
- fournir les repères indispensables à l'intégration d'un système global de gestion des risques.

**Compétences à acquérir :**

- Identifier les risques ;
- Traiter les risques ;

**Programme :**

Le cours envisage de nombreux aspects de la gestion des risques dans les secteurs financiers. Les principaux indicateurs de performance sont envisagés ainsi que les techniques de calibrage des fonds propres économiques.

**Chapitre 1 : L'entreprise et la Gestion des Risques****Chapitre 2 : Approche Patrimoniale**

- L'identification des risques : les typologies du risque ; approche patrimoniale, approche causale ; risque et processus ; la matrice des risques
- L'évaluation des risques : seuil de signification et risques majeurs ; approche top down, approche bottom up; la cartographie des risques
- Le traitement et suivi des risques : l'allocation des ressources ; la prévention ; le financement du risque

**Chapitre 2 : La mesure des Risques**

- Approche Value at Risk (VaR)

**Chapitre 3 : Risques et Outils de Benchmarking**

- Méthode DEA ( Data envelopment Analysis)

**Bibliographie :**

Bessis J., *Risk Management in Banking*, Wiley, 2000.

Descamps C., Soichot J., *Economie et Gestion de la banque*, Editions Ems, Magament et Société, 2002. Data Envelopment Analysis, A comprehensive Text with Models, Applications, References and DEA- Solver Software, W.W. Cooper, L.M. Seiford, K. Tone, Springer, 2008.

**Pré-requis :**

Aucun