

5.0 crédits

30.0 h

Enseignants:	Giot Pierre ;
Langue d'enseignement:	Français
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Thèmes abordés :	Ce cours porte sur la modélisation des taux d'intérêt et des risques du crédit avec un accent particulier sur les théories de courbe de rendement, les simulations de Monte Carlo et les approches fondées sur la segmentation. En ce qui concerne la modélisation des risques du crédit, nous nous concentrons sur les modèles d'estimation, les modèles de production-distribution.
Acquis d'apprentissage	avoir une bonne compréhension de la modélisation des taux d'intérêt (y compris la modélisation des taux d'intérêt en incertitude) et des modèles des crédit à risque <i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i>
Contenu :	Contenu : - théories des courbes de rendements, - modèles de simulations de Monte Carlo - approches par segmentation pour modéliser les taux d'intérêt en incertitude - modèles des risques liés au crédit (estimation, rendement, ...)
Autres infos :	Le cours fait référence principalement à deux livres : The course is mainly based on two book : 1) Santomero & Babbel : Financial Markets, Instruments & Institutions 2) Johnson : Bond evaluation, selection and management Examen écrit à la fin du cours
Cycle et année d'étude: :	> Master [60] en sciences économiques, orientation générale > Master [120] en sciences économiques, orientation générale
Faculté ou entité en charge:	ECON