

RISK MANAGEMENT



Niveau
d'étude
BAC +5



ECTS
2 crédits



Composante
Ecole
d'économie
de la
Sorbonne
(EES)



Volume
horaire
18h



Période de
l'année
Printemps

En bref

- > **Langue(s) d'enseignement:** Anglais
- > **Méthodes d'enseignement:** En présence
- > **Forme d'enseignement :** Cours magistral
- > **Ouvert aux étudiants en échange:** Non

plugin.odf:CONTENT_PROGRAM_TAB01_TITLE

Description

Summary: The objective of the course is to prepare students for the FRM (Financial Risk Manager) Level 1 certificate. The main valuation and risk models taught are:

- VaR and Expected Shortfall (parametric, non-parametric & hybrid approaches).
- Options, Binomial Trees, Black-Scholes model, Greeks, Hedging strategies.
- Bond valuation: Spot & Forward Rates, Returns, Spreads, Yields.
- Probability of Default (PD) and Loss Given Default (LGD).

The languages used are Python and R.

Professor: Daniel Petrov (Director - Master 2 Finance Technology Data)

Student assessment: Projects in Python / R.

Infos pratiques

Campus

› Maison des Sciences Économiques