

SYLLABUS

Domaine : Sciences Economiques, commerciales et sciences de gestion et Gestion ,**Filière :** Sciences économique

Spécialité : économie ,finance et marché

Semestre : 05

Année scolaire : 2025/2026

Identification de la matière d'enseignement

Intitulé : **économie de risque financières**

Unité d'enseignement : fondamental

Nombre de Crédits : 04

Coefficient : 03

Volume horaire hebdomadaire total :

- Cours (nombre d'heures par semaine) : 42
- Travaux dirigés (nombre d'heures par semaine) : 42
- Travaux pratiques (nombre d'heures par semaine) : /

Responsable de la matière d'enseignement

Nom, Prénom, Grade : BENAMARA DALILA ;MCB

Localisation du bureau (Bloc, Bureau) : /.....

Email : benamaradalila91@gmail.com

Tel (Optionnel) : ///.....

Horaire du cours et lieu du cours : lundi -08:30-11:30cours +TD

Description de la matière d'enseignement

Prérequis :

- 1-connaître les fondamentaux de la microéconomie et la macroéconomie.
- 2-connaître principe de finance : les principaux instruments financiers et leur rôle dans les marchés financiers.
- 3- connaître la théorie du portefeuille ; concept de rendement et de risque
- 4-maitrise des concepts statistique de base
- 5 -connaître le système financiers internationaux ; et les règlementations des banque et des marchés financiers

Objectif général du la matière d'enseignement :

Permettre a l'étudiant de comprendre les fondements théorique et les mécanismes économiques liées a l'identification ;la modélisation et la gestion des risques financiers

Objectifs d'apprentissage :

1. Comprendre la nature des risques financiers : Identifier et différencier les types de risques financiers (risque de crédit, risque de marché, risque de liquidité, risque opérationnel, risque systémique, etc.).
2. Analyser les mécanismes de transmission des risques : Étudier comment les risques financiers se propagent dans les marchés et les économies (crise financière).
3. Maîtriser les méthodes d'évaluation des risques : Approfondir l'analyse des indicateurs et des modèles d'évaluation du risque (Gap duration, Value-at-Risk, modèles de stress testing, etc.).
- 4.Étudier les outils de gestion des risques : Explorer les techniques et instruments financiers utilisés pour atténuer les risques (dérivés financiers, diversification, assurance, régulations bancaires, etc.).

Contenu de la matière d'enseignement

Chapitre 01: Introduction au Risque Financier

Section 1 : Définition Et Typologie Des Risques Financiers

Section 2 : Le Couple Rentabilité – Risque

Section 3 : Mesure Et Modélisation Des Risques Financiers

Section 4 : Gestion Des Risques Financiers dans un contexte de nouvelles technologies : crypto monnaies, block Chain , finance décentralisée , et IA.

Chapitre 02: Risque De Crédit

Section 1 : Introduction au Risque De Crédit

section 2 : Méthode d'évaluation Du Risque De Crédit

section 3 : Modélisation Du Risque De Crédit

section 4 : Gestion Du Risque De Crédit

Chapitre 03 : Risque de marché

section 01 : introduction aux marchés financiers

section 02 : type de stratégies d'investissement dans les M. F

section 03: MEDAF (CAMP) vs APT

Chapitre 04 : risque de taux d'intérêt

Section 1: introduction aux taux d'intérêt

Section 2 : mesure de risque de taux d'intérêt

Section 3 : gestion du risque de taux d'intérêt

Contenu de la matière d'enseignement

CHAPITRE 05 :risque de taux de change

Section1 :introduction aux risque de taux de change

Section 2 :mesure de risque de taux de change

Section 3 :gestion de risque de taux de change

CHAPITRE 06 :risque de liquidité

Section 01:introduction aux risque de liquidité

Section 02:mesure de risque de liquidité

Section 03:gestion de risque de liquidité

CHAPITRE 07 :risque opérationnel

Section 01:introduction aux risqu opérationnel

Section 02:mesure de risque opérationnel

Section 03:gestion de risque opérationnel

Modalités d'évaluation

Nature du contrôle	Pondération en %
Examen	60%
Micro – interrogation	
Travaux dirigés	30%
Travaux pratiques	
Projet personnel	
Travaux en groupe	5%
Sorties sur terrains	
Assiduité (Présence /Absence)	5%
Autres (à préciser)	
Total	100%

Références & Bibliographie

- 1) Markowitz ;H(1952) .portfolio selection .the journal of finance .
- 2) Hull;j.c.risk management and financial institutions .wiley finance .
- 3) Dionne ,G.(2013).risk management :history definition and critique .risk management and insurance review .
- 4) <https://www.ocde.org/fr/gouvernance/gestion-des-risques/>
- 5) https://www.bis.org/bcbs/basel3_fr.htm
- 6) <https://www.imf.org/en/Topics/financial-risk>

Planning du déroulement du cours

Semaine	Titre du Cours	Date
1ere Semaine	Chapitre 01: Introduction au Risque Financier	
2eme Semaine	Chapitre 02: Risque De Crédit	
3eme Semaine	Chapitre 03 : Risque de marché	
4eme Semaine		
5eme Semaine	Chapitre 04 :risque de taux d'intérêt	
6eme Semaine		
7eme Semaine	CHAPITRE 05 :risque de taux de change	
8eme Semaine	CHAPITRE 06 :risque de liquidité	
9eme Semaine		
10eme Semaine	TEST	
11eme Semaine	CHAPITRE 07 :risque opérationnel	
12eme Semaine		
13eme Semaine	Examen de fin de semestre	
14eme Semaine	Examen de rattrapage	

