

## CERTIFICAT DE SPECIALISATION

### STATISTIQUE ET GESTION QUANTITATIVES DES RISQUES BANCAIRES

Formation Continue

Code : GQRB

#### OBJECTIFS

Maîtriser les concepts et techniques de gestion des risques bancaires. Savoir réaliser des traitements simples et avancés sur des données bancaires en termes de modélisation des risques. Discerner la pertinence des outils employés comme leurs limites.

#### PREREQUIS

Niveau BAC + 2 minimum et notion R (formation R initiation).

#### Durée : 3 mois

Lieu : au siège de l'INSEDS et du BIIS

#### Prix

Tarif Etudiants ou demandeurs d'emploi :

**1.025.000 F.cfa**

Tarif Professionnels :

**1.225.000 F.cfa**

Tarif Entreprises - Administrations :

**1.425.000 F.cfa**

#### CONTENU

##### Logiciel R & PYTHON

- ✓ Initiation au langage R
- ✓ Initiation au langage PYTHON

##### Introduction à la gestion des risques bancaires

- ✓ La réglementation prudentielle Bale 1-2-3
- ✓ La transposition de Bale dans l'espace UEMOA

##### Le risque de crédit

- ✓ La probabilité de défaut
- ✓ Modélisation de la probabilité de défaut par régression logistique
- ✓ Grille de score et risque de crédit
- ✓ Déploiement par Visual Basic sous Excel
- ✓ Modélisation de la probabilité de défaut par réseaux de neurones

##### Le risque de crédit et exigence de Fonds Propres

- ✓ La méthode standard
- ✓ La méthode de base des notations internes
- ✓ La méthode avancée des notations internes

##### Le risque de marché et exigence de fonds propres

- ✓ La méthode standard
- ✓ La méthode des modèles internes

##### le risque opérationnel et exigence de fonds propres

- ✓ La méthode de l'indicateur de base
- ✓ La méthode standard
- ✓ La méthode avancée

##### Gestion Actif – Passif et risque de liquidité

Cas de synthèse (dernière semaine) Mise en œuvre sur ordinateur des notions vues au cours au travers d'une étude de cas sur le logiciel R



#### Intervenant

Didier Martial AKOSSO

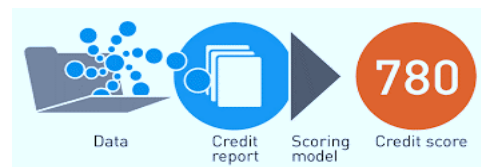
#### Logiciels utilisés

R – PYTHON

FORMATION  
à 90%  
PRATIQUE

#### Repères bibliographiques

Bart Baesens, Daniel Roesch, Harald Scheule  
Credit Risk Analytics : Measurement  
Techniques, Applications, and Examples in SAS,  
1<sup>ère</sup> édition.



| Bâle II                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Pilier I                                                                                                                                                        | Pilier II                                                                                                                                                                                   | Pilier III                                                                                                                                                       |
| Exigences minimales de fonds propres:<br>– Risque de crédit (nouvelles approches de calcul)<br>– Risque de marché (inchange)<br>– Risque opérationnel (nouveau) | Surveillance par les autorités prudentielles:<br>– Evaluation des risques et dotation en capital spécifiques à chaque banque<br>– Communication plus soutenue et régulière avec les banques | Transparence et discipline de marché:<br>– Obligation accrue de publication (notamment de la dotation en fonds propres et des méthodes d'évaluation des risques) |

#### MODE DE PAIEMENT

Espèce (à la comptabilité au siège de l'INSEDS et du BIIS)

Chèque libellé au nom de l'INSEDS

INSEDS – Data University // <http://inseai.wixsite.com/inseeds> // [inseeds@gmail.com](mailto:inseeds@gmail.com) // Abidjan Deux-Plateau Angré - Cité Manguiers

Tel : +225 01-41-08-08-50 / +225 27-22-21-14-13 / +225 07-77-24-19-96