

Table des matières

Préfaces	V
Introduction	XI
Remerciements	XVI
1 L'évolution du concept de risque	1
Section 1 Aux origines du risque	3
Section 2 Science et mesures du risque	4
Section 3 L'ingénierie du risque	23
2 La gestion du risque en entreprise (ERM)	31
Section 1 Référentiels de la gestion du risque	32
Section 2 Organisation de la gestion des risques en entreprise	41
Section 3 Stratégies de gestion des risques	54
3 Risques stratégique et opérationnel	60
Section 1 Présentation des risques stratégique et opérationnel	61
Section 2 Maîtrise des risques stratégique et opérationnel	76
4 Risques financiers	102
Section 1 Les risques de crédit et de liquidité	104
Section 2 Les risques de taux d'intérêt et de change	113

Section 3 Les risques actions et matières premières	119
Section 4 Contrôle des risques dans le processus de gestion de trésorerie	123
5 Contrôle interne, audit et gestion des risques	128
Section 1 La qualité de l'information comme facteur réducteur de risque	130
Section 2 Gestion du risque et contrôle interne	136
Section 3 Gestion du risque et audit	154
6 Instruments de couverture du risque financier	173
Section 1 La couverture du risque de taux d'intérêt	175
Section 2 La couverture du risque de change	190
Section 3 La couverture du risque de cours de matière première	201
Section 4 La couverture du risque de crédit	204
7 Pratique bancaire du risque	212
Section 1 Contrôle des risques dans le système bancaire	213
Section 2 La gestion des principaux risques par la banque	219
Section 3 la réglementation bancaire : de Bâle 2.5 à Bâle 3	229
8 Assurance et actuariat	239
Section 1 Les principes fondamentaux de l'assurance dans son rôle économique et social	241
Section 2 Les principes fondamentaux du droit des assurances	258
Annexe 1 Fondamentaux de <i>hedging</i> et mesure du risque financier	265
Section 1 Modèles d'évaluation d'options	266
Section 2 Value at risk et mesure du risque construite sur la performance	277
Section 3 Modèles de mesure du risque en assurance	279
Annexe 2 Rappels mathématiques	283
Section 1 Mathématiques financières : Finance de marché et risque	284
Section 2 Statistiques appliquées à la gestion des risques	285
Bibliographie	297
Index	300