

Code
420

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif Inter*
1751 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

PROCHAINES SESSIONS

- **PARIS :**
30-31 mai. 2024
- **A DISTANCE :**
30-31 mai. 2024
- **PARIS :**
28-29 nov. 2024
- **A DISTANCE :**
28-29 nov. 2024

[Voir toutes les sessions](#)

PUBLIC

Risk managers banque, assurance, asset managers et institutionnels - Personnel de la fonction IT - Analystes risques - Analystes quantitatifs - Contrôleurs - Managers middle office et leurs collaborateurs, toutes entités - CGP - Auditeurs - Senior bankers - Banquiers privés

PRÉ-REQUIS

Une expérience pratique en lien avec le risk management est recommandée

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-

Objectifs pédagogiques

- Préciser le cadre économique et réglementaire du Risk Management dans le secteur financier
- Identifier les différentes sources de risque
- Expliquer les principaux modèles et indicateurs de risques usuels, les problèmes d'implémentation et d'estimation

Programme de la formation

Les divers types de risques

- Risque de marché
- Risque de crédit
- Risque de liquidité
- Risque opérationnel

Introduction au management des Risques

- Concept d'appétence au risque, mesures qualitatives et quantitatives
- Le processus de management des risques : identification, mesure, management
- Introduction aux différentes mesures du risque : sensibilités, VaR, Capital économique, stress tests

Les méthodes de mesure des risques de marché

- Sensibilités : le cas des forwards, des options
- VAR paramétrique, historique, Monte-Carlo
- Expected Shortfall
- Problèmes d'estimation
- Backtests et stress-tests

Les méthodes de mesure des risques de crédit

- Méthode historique : la notation des contreparties, les agences de rating
- Approches structurelles : Merton, KMV
- Approche marché : estimation des probabilités de défaut à partir des prix des CDS et/ou des obligations
- Le risque de contrepartie : quantification (CVA), management, environnement réglementaire

Le risque de liquidité

- Liquidité funding vs liquidité transactionnelle
- Les sources du risque de liquidité
- Le management du risque : gaps, stress tests, plan de contingence

Parmi nos formateurs

même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.

- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
 - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service
 - ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation



Patrice Robin

Patrice est consultant indépendant sur les produits dérivés. Auparavant, Patrice a passé 10 ans en trading sur les dérivés de taux, successivement sur les produits structurés, les swaps vanille puis responsable des options de taux et de l'inflation au sein de Santander Global Markets à Londres.

