

# Formation Risques de Marché, Principes de mesure et facteurs de risques

## Présentation

Cette présentation vise à appréhender les enjeux inhérents au risque de marché par les principes d'évaluations de la VAR et de ses facteurs de risques (Delta, Gamma, Theta, Vega) et du stress testing relié à ce risque.

Durée : 7,00 heures (1 jours)

Tarif INTRA : Nous consulter

## Objectifs de la formation

- Comprendre les principes d'évaluations de la VAR
- Comprendre les facteurs de risques

## Prérequis

Toute personne ayant une expérience dans le domaine bancaire

## Public

Ce cours est réservé à toute personne intervenant ou voulant intervenir sur le sujet

## Programme de la formation

### Principes d'évaluations de la VAR :

- Principes généraux
- Différentes méthodes de calculs: statiques (historique, normale/stochastique) et dynamiques (riskmetrics)
- Granularité et consolidation des expositions

### Mesures des facteurs de risques :

- Delta
- Gamma
- Vega
- Theta
- Rho



**Stress testing**

- Définition générale
- Exemple de stress testing relié au risque de marché
- Mesure et ratio affectés

**Risque de taux de change**

- Définition générale
- Mesure et calcul
- Stress testing relié au risque du taux de change

**Actualisation des flux de trésorerie**

- Définition générale
- Mesure et calcul

## Organisation

**Formateur**

Les formateurs de Docaposte Institute sont des experts de leur domaine, disposant d'une expérience terrain qu'ils enrichissent continuellement. Leurs connaissances techniques et pédagogiques sont rigoureusement validées en amont par nos référents internes.

Riches de leur expérience sur le sujet, ils sauront accompagner vos collaborateurs dans leur montée en compétence.

**Moyens pédagogiques et techniques**

- Apports des connaissances communes.
- Mises en situation sur le thème de la formation et des cas concrets.
- Méthodologie d'apprentissage attractive, interactive et participative.
- Equilibre théorie / pratique : 60 % / 40 %.
- Supports de cours fournis au format papier et/ou numérique.
- Ressources documentaires en ligne et références mises à disposition par le formateur.
- Pour les formations en présentiel dans les locaux mis à disposition, les apprenants sont accueillis dans une salle de cours équipée d'un réseau Wi-Fi, d'un tableau blanc ou paperboard. Un ordinateur avec les logiciels appropriés est mis à disposition (le cas échéant).

## **Dispositif de suivi de l'exécution et de l'évaluation des résultats de la formation**

En amont de la formation :

- Recueil des besoins : permet de récolter des informations sur le stagiaire (profil, formation, attentes particulières, ...).
- Auto-positionnement des stagiaires afin de mesurer le niveau de départ.

Tout au long de la formation :

- Évaluation continue des acquis via des questions orales, exercices / projet fil rouge, des QCM, des cas pratiques et mises en situation.

A la fin de la formation :

- Auto-positionnement des stagiaires afin de mesurer l'acquisition des compétences.
- Evaluation du formateur des compétences acquises par les stagiaires.
- Questionnaire de satisfaction à chaud : permet de connaître le ressenti des stagiaires à l'issue de la formation.
- Questionnaire de satisfaction à froid : permet d'évaluer les apports réels de la formation et leurs mises en application au quotidien.

## **Accessibilité**

Nos formations peuvent être adaptées à certaines conditions de handicap. Nous contacter pour toute information et demande spécifique.