

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

- Alternance d'apports théoriques et de mises en pratique contextualisées.
- Progression pédagogique structurée, de la compréhension à la mise en œuvre opérationnelle.
- Pédagogie immersive favorisant une mise en application immédiate des compétences.
- Formation interactive et participative s'appuyant sur des ateliers pratiques, études de cas et échanges collectifs (+ 60 % du temps de formation.)
- Séquences pédagogiques rythmées et évaluations formatives régulières pour renforcer l'ancrage des apprentissages.

- Supports de cours, ressources documentaires et références mis à disposition par le formateur

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

En amont de la formation *(évaluation en ligne dans l'extranet apprenant)*

- Recueil des besoins et des attentes des participants.
- Auto-positionnement permettant d'évaluer le niveau initial des apprenants.

Tout au long de la formation

- Évaluations continues réalisées par le formateur travers des questions orales, exercices, QCM, études de cas et mises en situation pratiques.

À l'issue de la formation *(évaluations en ligne dans l'extranet apprenant)*

- Auto-positionnement afin de mesurer l'acquisition des compétences visées.
- Validation de l'acquisition des compétences par le formateur
- Questionnaire de satisfaction « à chaud » à l'issue de la formation
- Questionnaire de satisfaction "à froid", 45 jours après la formation afin d'évaluer l'ancrage des acquis et leur mise en application en situation professionnelle.

Accessibilité

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