

Formation Risques de Contreparties, Mesures et encadrement

Présentation

Suite aux différentes crises de ces dernières décennies, les réglementations (Bâle, Dodd Franck, EMIR) poussent les banques d'investissement à un meilleur encadrement de leurs risques de contreparties, plus particulièrement sur les dérivés.

Dans ce contexte il est important de comprendre les mécanismes d'évaluations des expositions et d'encadrement des risques de contreparties et leurs impacts réglementaires.

Durée : 7,00 heures (1 jours)

Tarif INTRA : Nous consulter

Objectifs de la formation

- Comprendre les mécanismes d'évaluations des expositions
- Comprendre l'encadrement des risques de contreparties et leurs impacts réglementaires

Prérequis

Avoir 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

Typologies de risques par produit et les techniques de réduction des risques enjeux :

- Risque de remplacement (nettings bilatéraux (close-out netting) et multi-latéraux, appels de marge, deposits)
- Risque débiteur
- Risque de règlement livraison (nettings de règlement livraison)
- Risque émetteur



Mesures des expositions relatives aux risques de contreparties par types de risques :

- Principes de calcul par type de risques
- Simulation Monte Carlo pour le risque de remplacement
- Différences entre modèle interne et modèle balois (EAD)

Encadrement des expositions :

- Consolidation des expositions
- Autorisations : limites et accords ponctuels
- Calculs des dépassements et disponibles

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.