

● Mesure et gestion du risque de marché

Calculer, calibrer et produire la Value At Risk (VaR)

Code
416

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

PUBLIC

Département risque de marché
Front Office (banque- assurance- sociétés de gestion -Financial Institutions Group - Investisseurs institutionnels- - Analystes quantitatifs - Risk managers - Gérants - Traders - Département IT - SSII banque-assurance en inter contrat

PRÉ-REQUIS

La participation à cette formation requiert une aisance sur les matières quantitatives et une expérience en lien avec la gestion ou le risque de marché

NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

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-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

Objectifs pédagogiques

- Calculer la VaR suivant différentes méthodes
- Evaluer les différences et les limites des principaux modèles
- Calculer la VaR sur un portefeuille global, en intégrant l'optionnalité et la convexité

Programme de la formation

Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur recevra vos objectifs de progrès.

Calculer la VaR suivant différentes méthodes

Lister les principes et exigences réglementaires

- Schématiser les grandes définitions
- Appliquer les exigences réglementaires
- Etablir la déclaration des fonds propres
- Exercice

Représenter les 3 principaux modèles

- VaR paramétrique
- VaR historique
- Monte-Carlo
- TP Excel : implémentation des 3 modèles sur un portefeuille simple

Gérer la VaR sur un portefeuille global, en intégrant l'optionnalité et la convexité

Mettre en œuvre le traitement de l'optionnalité

- Risque de convexité
- Risque de véga
- Risque de smile
- TP Excel : implémentation d'une VaR Monte-Carlo sur une option et sa

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

ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : care-formation@lefebvre-dalloz.fr

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

couverture

Mettre en œuvre le backtesting

- Implémentation d'un backtesting
- Comparer ce qui est comparable
- Gérer le dépassement de limites
- Gérer les exceptions de backtesting
- Combien d'exceptions ?
- TP Excel

Comparaison des performances entre VaR paramétrique et historique • Evaluer les différences et les limites des principaux modèles

Les grandes familles de facteurs de risque par marché

- Tour d'horizon des principaux marchés : Actions – Fixed Income – Taux – Commodities – Crédit
- Les subtilités du calcul des écarts-types et des corrélations
- Comparaison des performances entre VaR paramétrique et historique Rythme de production de la VaR et aspects S.I.
- Les grandes étapes d'une journée de production

Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

A noter

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.

