

## ● Risk management en banque : les fondamentaux

Identifier, mesurer et gérer les risques

Code  
**420**

Durée  
**2 jours / 14 heures**

Tarif Inter\*  
**1795 € HT**

\*Repas inclus (en présentiel)

### PUBLIC

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

### PRÉ-REQUIS

Avoir une expérience pratique en lien avec le risk management

### 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-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

## 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

### 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.

### 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

#### 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](mailto: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.

- 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

#### 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.

## Prochaines sessions

...

### PARIS

- 22-23 Sep. 2026
- 18-19 Nov. 2026

### A DISTANCE

- 22-23 Sep. 2026
- 18-19 Nov. 2026

