

● Risque de Marché, VAR et MTM – Instant learning

Méthodes d'évaluation du risque de marché

Code
702972

Durée
3 heures / 3 heures

Tarif Inter*
399 € HT

**Repas inclus (en présentiel)*

Objectifs pédagogiques

- Etablir la VaR
- Appliquer la Stressed Var comme indicateurs de mesure
- Gérer et couvrir les risques

Programme de la formation

Engagement

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

Etablir la VaR

- Définir la méthode historique
- Etudier la méthode de variance-covariance
- Appliquer la méthode de Monte Carlo
- Etudier le P&L de VaR, le P&L de VaR par les sensibilités
- Back testing
Appliquer la Stressed Var comme indicateurs de mesure
- Définir la méthode de calcul
- Choisir la période d'observation
- Ajouter les fonds propres réglementaires supplémentaires
Gérer et couvrir les risques
- Définir l'Expected Shortfall (ES), et sa méthode de calcul
- Stress Tests: définitions et intérêts, cas de crises historiques
- Cas pratiques : calcul de la VaR par la méthode paramétrique ou la méthode des sensibilités

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

PUBLIC

Département Market Risk (Banques – Assurances– Sociétés de gestion) – Risk managers – Relation Investisseurs institutionnels – Financial Institution Group – Analystes quantitatifs – Gérants – Traders Jjuniors – Département IT – SSII banque-assurance en inter contrat – Nouveaux entrants dans le domaine

PRÉ-REQUIS

Aucun prérequis nécessaire

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

LES POINTS FORTS

Format condensé pour maximiser l'acquisition de compétences opérationnelles

Flexibilité grâce à un format entièrement à distance et court

Alternance d'éléments techniques et exercices pratiques

Peut être associé à d'autres classes virtuelles pour approfondir progressivement vos compétences

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 Service
 - ▶ A froid, 40 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.

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



Prochaines sessions

...

A DISTANCE

- 1 Déc. 2026

