

## ⋮ Risque de marché, indicateurs de risque et gestion – Instant learning

Evaluer et gérer le risque de marché

Code  
**702975**

Durée  
**3 heures / 3 heures**

Tarif Inter\*  
**399 € HT**

*\*Repas inclus (en présentiel)*

### PUBLIC

Département Market Risk (Banques – Assurances– Sociétés de gestion) – Risk managers – Inspection – Audit interne –Financial Institution Group – Analystes quantitatifs – Gérants ou Traders junior– Département IT – SSII banque–assurance en inter contrat – Nouveaux entrants dans le domaine

### PRÉ-REQUIS

La participation à cette formation requiert une connaissance des instruments financiers standards et une connaissance de base de la valorisation d'un instrument financier

### 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

## Objectifs pédagogiques

- Identifier les facteurs de risques de marché
- Déterminer et calculer les indicateurs de mesure
- Expliquer, 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.

## Identifier les facteurs de risques de marché

### Définir et classer les activités de marchés

- Spéculation
- Couverture
- Arbitrage
- Matérialisation du risque de marché
- Exercice

### Identifier les facteurs de risques

- Définir les paramètres de marché explicites
- Expliquer les paramètres implicites
- Appliquer les paramètres de modèles
- Cas pratique

## Déterminer et calculer les indicateurs de mesure

### Déterminer les indicateurs de mesure

- Mesurer les risques sur horizons courts
- Choisir les modèles de valorisation
- Définir les sensibilités de premier ordre
- Définir les sensibilités de second ordre

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](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.

- Gérer et couvrir les risques,
- Encadrer et suivre les risques
- Etablir les limites de risques

## Expliquer, gérer et couvrir les risques

### Expliquer le P&L par les sensibilités :

- Utiliser la formule de Taylor,
- Explained PnL Delta, Explained PnL Vega, Explained PnL Rho, Explained PnL Theta, Explained PnL Gamma, Explained PnL Vomma, Explained PnL Vanna
- Cas pratiques :
- Pricing d'une option sur action
- Calcul des sensibilités
- Explication d'un PnL par des sensibilités d'ordre 1
- Explication d'un PnL par des sensibilités d'ordre 2

### 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.