

● Credit Valuation Adjustment – CVA : gérer le risque de contrepartie – Workshop

Calculer, calibrer et utiliser la CVA

Code
702976

Durée
3 heures / 3 heures

Tarif Inter*
450 € HT

**Repas inclus (en présentiel)*

PUBLIC

Département risque de marché – Front Office (banque– assurance– sociétés de gestion) – Analystes quantitatifs – Risk managers – Gérants et Traders en prise de poste– Département IT – SSII banque–assurance en inter contrat– Nouveaux entrants dans le domaine

PRÉ-REQUIS

La participation à cette formation requiert une connaissance de base sur les risques financiers et de bonnes connaissances mathématiques

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

LES POINTS FORTS

Session très interactive avec de nombreux calculs pratiques

Apprentissage par l'action avec des cas pratiques ciblés

Valeur ajoutée des échanges et du partage d'expériences entre participants

Possibilité de combiner plusieurs ateliers pour un parcours d'apprentissage complet

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-

Objectifs pédagogiques

- Etablir les caractéristiques de la CVA
- Modéliser le risque CVA

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 les caractéristiques de la CVA

Cerner les différences entre CCR et CVA

- Décrire la CVA unilatérale,
- Appliquer la CVA bilatérale,
- Expliquer la DVA,
- Cas pratique : CVA et Right/Wrong way risk

Modéliser le risque CVA

Calculer l'Expected Exposure (EE),

- Estimer le Loss Given Default (LGD),
- Calculer la Probability of Default (PD),
- Desk CVA, Option CVA, Hedging CVA ;
- Calculer le risque CVA: Basic-Approach (BA-CVA),
- Calculer le risque CVA : Standardized Approach (SA-CVA)
- Cas fil rouge : calcul de la BA-CVA sur un portefeuille de produits dérivés

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

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

