BANQUE - ASSURANCE

Risque de marché : mesurer les expositions, calibrer la VaR et piloter les limites

Les indicateurs de risque de marché sont souvent produits sans être discutés. La valeur en risque est publiée chaque matin mais les hypothèses du modèle ne sont plus contestées. Les dépassements de limites sont régularisés sans analyse. Le dispositif existe sur le papier et perd sa valeur d'alerte. Ces deux jours s'adressent à des praticiens. Vous reprenez les mesures de sensibilité par classe d'actifs. Vous comparez les méthodes de calcul de la valeur en risque et leurs hypothèses. Vous construisez un programme de backtesting et des scénarios de stress défendables. Vous articulez enfin ces mesures avec un système de limites et une gouvernance d'escalade.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
2 jours — 14 h	**Présentiel ou à distance**	**À partir de 1 880 € HT**	**11 jours ouvrés après validation du financement.**

Mon Pôle Formation est un organisme certifié Qualiopi. La certification qualité a été délivrée au titre de la catégorie d'action suivante : **ACTIONS DE FORMATION** — certificat n° 76 31 02622 31 (SGS ICS)

01 Public visé et prérequis

PUBLIC VISÉ
Risk managers et contrôleurs des risques de marché ainsi que les gérants les opérateurs de salle et les auditeurs internes intervenant sur les activités de marché.

PRÉREQUIS
Pratiquer les instruments de marché et disposer de bases solides en statistiques.

POSITIONNEMENT À L'ENTRÉE
Analyse du besoin et test de positionnement. Vos réponses sont partagées avec votre formateur afin d'adapter la formation à votre niveau et votre contexte professionnel.

02 Objectifs pédagogiques

À l'issue de la formation, le participant sera capable de :

- Calculer les sensibilités des positions par facteur de risque
- Comparer les méthodes de calcul de la valeur en risque et leurs limites
- Construire un programme de backtesting et en interpréter les exceptions
- Concevoir des scénarios de stress adaptés au portefeuille
- Structurer un dispositif de limites et sa procédure d'escalade

03 Programme détaillé

M1 Facteurs de risque et sensibilités

- Savoir de quoi dépend la valeur d'une position
- Cartographie des facteurs de risque
- Sensibilités taux change et actions
- Grecques des positions optionnelles
- Agrégation et effets de compensation
- Atelier : Chaque participant décompose un portefeuille mixte par facteur de risque et calcule ses sensibilités.

M2 La valeur en risque

- Une mesure utile à condition d'en connaître les hypothèses
- Approche historique et approche paramétrique
- Simulation de Monte Carlo
- Horizon intervalle de confiance et agrégation
- Limites de la mesure et indicateurs complémentaires
- Cas pratique : Les participants calculent la VaR d'un même portefeuille par plusieurs méthodes et expliquent les écarts.

M3 Validation et stress testing

- Confronter le modèle à la réalité
- Backtesting et analyse des exceptions
- Construction de scénarios historiques
- Scénarios hypothétiques et stress inversé
- Risque de liquidité et de concentration
- Atelier : Les participants bâtissent un scénario de stress et en mesurent l'impact sur les positions du portefeuille.

M4 Dispositif de limites et gouvernance

- Transformer la mesure en décision
- Architecture des limites par activité
- Suivi des dépassements et escalade
- Reporting aux comités et aux dirigeants
- Articulation avec le contrôle permanent
- Mise en situation : Les participants instruisent un dépassement de limite et présentent leurs conclusions au comité des risques.

04 Modalités pédagogiques, méthodes et moyens

MODALITÉS PÉDAGOGIQUES
Présentiel ou à distance

LIEU / FORMAT
Dans vos locaux — jusqu'à 10 collaborateurs, Paris — Présentiel, À distance — Classe virtuelle

MÉTHODES MOBILISÉES
• Apports théoriques, ateliers et cas pratiques. Support de cours numérique et fiches méthodes fournis.

ENCADREMENT
Formateurs qualifiés et expérimentés, experts de leur domaine, sélectionnés par Mon Pôle Formation.

05 Modalités d'évaluation et de suivi

ÉVALUATION DES ACQUIS
• QCM et mises en situation. Évaluation des acquis en début et en fin de parcours, évaluation à chaud et à froid à 60 jours.

SUIVI DE L'EXÉCUTION
• Émargement des participants
• Certificat de réalisation remis à l'issue de la formation

SANCTION DE LA FORMATION
Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

06 Type de reconnaissance

Formation non certifiante — Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

07 Modalités d'accès, financement et tarifs

MODALITÉS D'INSCRIPTION
Inscription en ligne, par téléphone, par devis ou via votre OPCO.

DÉLAI D'ACCÈS
11 jours ouvrés après validation du financement.

FINANCEMENTS POSSIBLES
- OPCO et plan de développement des compétences
- FAF et CFP
- France Travail
- Paiement jusqu'à 6 fois sans frais

DATES / SESSIONS
Entrées permanentes

FORMULE	DÉTAIL	TARIF
Inter-entreprises	-10 % dès 2 participants, -15 % dès 3, -20 % à partir de 4 inscrits sur la même session.	**À partir de 1 880 € HT**

Prix nets — exonération de TVA, article 261-4-4° du CGI.

08 Accessibilité aux personnes en situation de handicap

Accessible aux personnes en situation de handicap. Contactez notre référent handicap pour construire une solution adaptée : contact@monpoleformation.fr

RÉFÉRENT HANDICAP
Tiffany LESTROUBAC

CONTACT
contact@monpoleformation.fr

09 Indicateurs de résultats

INDICATEUR	RÉSULTAT	MODALITÉS DE CALCUL
Taux de satisfaction	**N/A**	Moyenne des notes de satisfaction des stagiaires sur les 12 derniers mois
Taux d'abandon	**N/A**	Calculé sur les 12 derniers mois

Résultats arrêtés au 29/09/2026. N/A : donnée non disponible ou effectif insuffisant sur la période.

10 Contacts

INSCRIPTIONS ET INFORMATIONS
contact@monpoleformation.fr
01 87 66 57 66

ADRESSE
10a rue du Maréchal de Lattre de Tassigny, 76420 Bihorel

RÉCLAMATIONS
Par e-mail : contact@monpoleformation.fr