BANQUE - ASSURANCE

Risque de marché : suivre les sensibilités, fixer les limites et couvrir

Un dispositif de suivi du risque de marché ne se résume pas à un indicateur synthétique. Les sensibilités par facteur de risque, les positions nettes par maturité et les tests de résistance disent des choses différentes et parfois contradictoires. Quand une limite est dépassée la question devient opérationnelle : qui décide et avec quel instrument. Trois heures à distance centrées sur la gestion et non sur le calcul : construire une grille d'indicateurs cohérente, calibrer des limites qui ont un sens, organiser la chaîne d'alerte et choisir les instruments de couverture adaptés. Ce module complète l'approche des mesures de valorisation en se plaçant du côté du pilotage quotidien.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
0,43 jour — 3 h	**À distance**	**À partir de 590 € 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
Responsables des risques de marché gestionnaires de portefeuille trésoriers et contrôleurs internes chargés du suivi des expositions.

PRÉREQUIS
Connaître les instruments de marché courants et les principaux indicateurs de risque.

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 :

- Construire une grille d'indicateurs adaptée aux positions détenues
- Interpréter les sensibilités par facteur de risque
- Calibrer un dispositif de limites et de seuils d'alerte
- Organiser le traitement d'un dépassement de limite
- Choisir un instrument de couverture cohérent avec l'exposition

03 Programme détaillé

M1 Cartographier les expositions

- Savoir à quoi l'on est sensible
- Identifier les facteurs de risque portés par les positions
- Lire les sensibilités de taux de change et d'actions
- Construire des positions nettes par maturité
- Repérer les risques de base et les corrélations instables
- À retenir : Une exposition nette faible peut masquer des sensibilités opposées qui se dénoueront à des rythmes différents.

M2 Limites seuils et alertes

- Donner une portée opérationnelle aux indicateurs
- Définir les natures de limites et leur articulation
- Calibrer les seuils au regard de la capacité de perte
- Organiser la remontée d'un dépassement
- Documenter les décisions prises
- Cas pratique : Construction d'un tableau de limites pour un portefeuille donné puis traitement d'un dépassement constaté.

M3 Gérer et couvrir

- De l'alerte à la décision
- Choisir entre réduction de position et couverture
- Sélectionner l'instrument de couverture adapté
- Mesurer l'efficacité de la couverture mise en place
- Rendre compte au comité des risques
- Mise en situation : Comité des risques simulé sur une exposition dégradée avec arbitrage entre plusieurs options de couverture.

04 Modalités pédagogiques, méthodes et moyens

MODALITÉS PÉDAGOGIQUES
À distance

LIEU / FORMAT
Dans vos locaux — jusqu'à 10 collaborateurs, 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 590 € 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