BANQUE - ASSURANCE

Risque de marché VaR et MTM : valoriser, mesurer et interpréter les résultats

La VaR circule dans tous les reportings de risque sans que chacun sache ce qu'elle recouvre : quelle méthode de calcul, quel horizon, quel niveau de confiance et quelles données historiques. La valorisation au marché subit le même sort entre prix observés et modèles internes. Les discussions entre front office contrôle des risques et direction s'enlisent faute de définitions partagées. Trois heures à distance pour reconstruire les deux notions : mécanique de la valorisation au marché, méthodes de calcul de la VaR et lecture critique des chiffres produits. Le module insiste sur les limites de l'indicateur et sur les contrôles qui l'accompagnent plutôt que sur la démonstration mathématique.

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
Contrôleurs des risques analystes de middle office auditeurs internes et collaborateurs de la conformité travaillant sur des portefeuilles de marché.

PRÉREQUIS
Connaître les principaux instruments financiers et les bases du calcul statistique.

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 :

- Expliquer le principe de la valorisation au marché et ses sources de prix
- Distinguer les méthodes de calcul de la VaR et leurs hypothèses
- Interpréter une VaR au regard de son horizon et de son niveau de confiance
- Identifier les limites de la VaR et les indicateurs qui la complètent
- Questionner un reporting de risque de marché et les chiffres qu'il présente

03 Programme détaillé

M1 La valorisation au marché

- Du prix au résultat
- Situer le mark to market dans le suivi des positions
- Identifier les sources de prix et leur fiabilité
- Distinguer valorisation par prix observé et par modèle
- Repérer les ajustements de valorisation courants
- À retenir : Une valorisation issue d'un modèle reste une estimation dont les hypothèses doivent être documentées et revues.

M2 Calculer une VaR

- Trois chemins un seul indicateur
- Poser les paramètres d'horizon et de niveau de confiance
- Construire une VaR historique
- Mettre en oeuvre une VaR paramétrique
- Comprendre l'approche par simulation
- Comparer les résultats obtenus
- Cas pratique : Calcul de la VaR d'un portefeuille simple par trois méthodes puis analyse des écarts constatés.

M3 Lire et contester les chiffres

- Ce que la VaR ne dit pas
- Identifier les limites de l'indicateur en période de tension
- Situer le contrôle a posteriori et son rôle
- Compléter la VaR par des mesures de perte extrême
- Formuler les questions à poser au producteur du chiffre
- Atelier : Revue d'un reporting de risque de marché avec repérage des chiffres à faire expliquer.

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