

# Gérez les risques de marché

<b>DUREE :</b>	1 jour
<b>PRIX HT :</b>	1.050 €
<b>REFERENCE :</b>	RSK - MKT

## PROCHAINE SESSION

### 1 Identifiez les risques de marché

- Parmi les autres risques (crédit, opérationnel, systémique, juridique, liquidité, efficacité, etc.)
- Maîtrisez les différentes natures de risques : taux, change, dérivés de taux, actions et dérivés actions, dérivés de crédit, options de change, commodities
- Analysez les produits nouveaux (hybrides, dérivés climatiques, produits inflation,...)
- Quels sont les principaux facteurs de risque : cours de change et leurs surfaces de volatilité, taux et surfaces de volatilité, spreads émetteurs, marge de basis, etc. ?

### 2 Mesurez les risques de marché

- Mettez en place la méthodologie de mesure : différents types de VaR (paramétrique, historique, Monte-Carlo), limites de la VaR (facteurs de risques non pris en compte, risque de modèle, incertitude sur paramètres de marché), indicateurs complémentaires à mettre en place
- Maîtrisez la notion de réfactions

- Mettez en place une approche en stress scenarios
- Faites le backtesting
- Approche croisée Risques/Résultats et notion de Stop-loss

### 3 Gérez les risques de marché

- Définissez et mettez en place vos limites (produits standard, produits nouveaux)
- Organisez le suivi des risques : processus de surveillance, remontée des informations, gestion des dépassements

### 4 Consolidez les risques de marché

- Comment concilier les approches spécifiques au niveau d'un desk et la consolidation au niveau du groupe ?

### 5 Mesurez les fonds propres à affecter aux risques de marché

- Maîtrisez le nouveau contexte réglementaire (risques crédit, marché, opérationnel)
- Mettez en place votre modèle interne

### Objectifs du stage

- Identifiez, mesurez et gérez les différents risques de marchés
- Calculez l'allocation de capital à affecter aux métiers de marché
- Maîtrisez la Value At Risk

### Connaissances requises :

- Connaissances bancaires de base

*Ce module est animé par :  
Denis GOBILLOT  
Risk Manager au Crédit Lyonnais*