

Mesure et gestion du risque de marché – FARM

Code produit : FARM

Niveau : Perfectionnement

Modalité : Presentiel

Durée (en heure) : 7.0

Tarif : 0,00 € HT

Eligible DDA : non

Public :

Toute personne intéressée
par la gestion du risque de
marché

Prérequis :

Aucun

Objectif

- Comprendre les opérations et risques visés
- Distinguer les différentes formes de risque de marché
- Recenser les facteurs de risques
- Connaître le cadre réglementaire

Programme de la formation

1. Marché

- Définition et importance des risques de marché
 - Concepts de base des risques de marché
 - Importance dans le secteur bancaire

- 4 principaux types de risques de marché
- 2. Risques associés
 - Risque de taux : indices de marché
 - Risque de change : cours
 - Risque action : émetteur et marché
- 3. Facteurs de risques
 - Concentration versus diversification
 - Couverture et exposition
 - Volatilité et sensibilités
- 4. Cadre réglementaire
 - Normes internationales - standards du Comité de Bâle
 - Cadre révisé du risque de marché
 - Exigences minimales de fonds propres en regard du risque de marché
 - Textes européens CRD - CRR
 - Réglementation française
 - Transposition des CRD et application CRR
 - Arrêté du 3/11/14 chapitre III : mesure des risques de marché (articles 122 à 133)

Moyens d'évaluation

- Evaluation des acquis de la formation par le biais de QCM et/ou d'exercices pratiques
- Questionnaire de satisfaction à chaud complété par chacun à l'issue du stage
- Questionnaire d'évaluation à froid complété par chacun entre 2 et 3 mois après le stage

Méthodes pédagogiques

- Exposés à partir d'un diaporama
- Echanges d'expériences
- Etudes de cas et exercices pratiques



AF2A - 64 Rue de Miromesnil, 75008 Paris

Copyright 2024 AF2A. Tous droits réservés.