



SÉMINAIRE

INTRODUCTION AU RISK MANAGEMENT

ANIMÉ PAR

BRUNO CASSIANI

Consultant

BERNARD SURINResponsable du Risk Management
des fonds structurés et garantis
AMUNDI**PHILIPPE CUXAC**Méthodologie Quantitative Risk
de ContrepartieCODE WEB : **INTRORM**NIVEAU : **ACQUISITION**DURÉE : **2 JOURS**PRIX NET DE TAXES : **2 440 €***DATES : **30/09 et 01/10/2019**

*Montant sur lequel il n'est pas appliqué de TVA
(Prestation de formation professionnelle continue
exonérée de TVA).

OBJECTIFS

- Avoir une vision globale de l'organisation du risk management au sein d'un établissement financier
- Connaître le rôle et les responsabilités des acteurs internes et externes impliqués dans le risk management
- Appréhender les étapes clés d'une méthodologie de calcul, de gestion et de suivi des grandes catégories de risque (marché, crédit, opérationnel et liquidité)
- Comprendre les mesures et les indicateurs de risques, leurs champs d'application et leurs limites
- Connaître l'impact des risques sur les fonds propres
- Connaître les évolutions réglementaires en cours

ATOUTS

- Vision globale de tous les aspects du risk management
- Étude des meilleures pratiques
- Concepts systématiquement replacés dans le contexte réglementaire et économique
- Remise de l'ouvrage « L'essentiel des marchés financiers » (Editions Eyrolles, Collection FIRST FINANCE)

POUR ALLER PLUS LOIN

- Risk management sur opérations de marché 1 : évaluation des risques
- Risk management sur opérations de marché 2 : techniques avancées d'évaluation des risques
- Introduction à la Value at Risk (VaR)

INFORMATIONS ET INSCRIPTIONS

Tél. : **+33 (0)1 44 53 82 00**E-mail : **sales@first-finance.fr****1 / Cartographie des risques des établissements financiers et de leurs activités**

- Notions de risque et de facteurs de risque
- Risques associés aux différentes activités
- Risques classiques et nouveaux risques

2 / Acteurs du risk management

- Rôle et responsabilités des acteurs internes
- Acteurs externes : autorités de tutelle et régulateurs nationaux et européens

3 / Organisation et mise en place du risk management

- Dispositifs internes et aspects opérationnels
- Exigences réglementaires (réformes de Bâle)
- Liens entre capital économique et capital réglementaire

4 / Introduction au risque de marché

- Notion de Mark-to-Market et risque sur opérations de marché
- Indicateurs de risques de marché
 - . Sensibilité du prix aux facteurs de risque
 - . Concept de Value at Risk (VaR) : présentation des trois méthodes de VaR (historique, paramétrique et Monte Carlo)
 - . Stress tests
 - . Suivi et pilotage des risques de marché
- Traitement réglementaire du risque de marché : de Bâle I à Bâle III et évolutions récentes

Travaux Pratiques

- Étude comparative des indicateurs pour différentes positions de marché

5 / Introduction au risque de crédit

- Définition du risque de crédit
- Probabilité de défaut et taux de recouvrement
- Notion de rating
- Spread de crédit
- Couverture du risque de crédit
- Introduction à la notion de risque de contrepartie sur opérations de marché : typologie et présentation simple des méthodes de mesure

Travaux Pratiques

- Analyse du risque de crédit sur différentes opérations

6 / Approche réglementaire du risque de crédit (Bâle II et Bâle III)

- Différentes méthodes : standard et interne (IRB)
- Indicateurs bâlois (EAD, PD, LGD, M, ...)
- Ratio de solvabilité

7 / Introduction au risque de liquidité

- Analyse et gestion du risque de liquidité
- Traitement réglementaire et ratios de liquidité

8 / Introduction au risque opérationnel

- Typologie des risques opérationnels
- Identification et cartographie
- Exemple de suivi et pilotage des risques opérationnels
- Traitement réglementaire du risque opérationnel

9 / Synthèse

- Enjeux d'une gestion globale des risques

