

Mesure et gestion du risque de marché : maîtrisez la volatilité et sécurisez les portefeuilles financiers

Lien : https://innov-maroc.com/formation/mesure-et-gestion-du-risque-de-marche-maitrisez-la-volatilite-et-securisez-les-portefeuilles-financiers

DURÉE
5 jours (35h)

RÉFÉRENCE
FA102

CATÉGORIE
Gestion des Risques et Gestion Actif/Passif

INNOV MAROC

🎯 OBJECTIFS DE LA FORMATION

À l'issue de cette formation, vous serez capable de :

- ✔ Comprendre les différents types de risques de marché
- ✔ Maîtriser les méthodes de mesure du risque financier
- ✔ Utiliser les outils comme la VaR et le stress testing
- ✔ Identifier les facteurs de volatilité des marchés
- ✔ Construire des stratégies de couverture efficaces
- ✔ Optimiser la gestion de portefeuille en fonction du risque
- ✔ Mettre en place des systèmes de suivi des risques
- ✔ Appliquer les normes réglementaires internationales
- ✔ Analyser les scénarios de crise financière
- ✔ Développer une expertise en gestion des risques financiers

👥 POUR QUI ?

- ✔ Risk managers
- ✔ Analystes financiers
- ✔ Gestionnaires de portefeuille
- ✔ Traders
- ✔ Banquiers d’investissement
- ✔ Auditeurs financiers
- ✔ Contrôleurs de risque
- ✔ Toute personne impliquée dans la gestion des risques financiers

INNOV MAROC



Programme détaillé

1 / Introduction au risque de marché

- Définition du risque de marché
- Sources de volatilité financière
- Enjeux pour les institutions financières

2 / Typologie des risques de marché

- Risque de taux d’intérêt
- Risque de change
- Risque actions et matières premières

3 / Mesure du risque de marché

- Indicateurs de volatilité
- Sensibilités (Greeks)
- Facteurs de risque principaux

4 / Value at Risk (VaR)

- Méthodes de calcul de la VaR
- Paramétrique, historique et Monte Carlo
- Limites de la VaR

INNOV MAROC

5 / Stress testing et scénarios extrêmes

- Tests de résistance financière
- Scénarios de crise
- Impact des chocs de marché

6 / Gestion de portefeuille et allocation des risques

- Diversification des actifs
- Allocation stratégique
- Arbitrage risque/rendement

7 / Instruments de couverture du risque

- Dérivés financiers (options, futures, swaps)
- Stratégies de hedging
- Réduction de l’exposition globale

8 / Suivi et monitoring des risques

- Tableaux de bord de risque
- Indicateurs clés de performance (KRI)
- Reporting des risques

9 / Cadre réglementaire et conformité

- Accords de Bâle
- Exigences prudentielles
- Gouvernance du risque

10 / Études de cas et applications pratiques

- Analyse de crises financières
- Gestion du risque en conditions réelles

INNOV MAROC

- Optimisation des stratégies de couverture

Approche pédagogique

- Support Ecrit et Projection
- Exposés Interactifs, Podcasts et Vidéos
- Brainstorming et Jeux de Rôle
- Mises en Situation pour faciliter l'assimilation
- Cas Pratiques et Labs inclus pour leur impact opérationnel
- Test de Validation des Acquis des Connaissances

Prochaines dates programmées

15 au 19 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 16 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
07 au 11 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
02 au 06 Août 2027	Présentiel - Casablanca
27 Sep. au 01 Oct. 2027	Présentiel - Casablanca

Autres dates possibles sur demande. Contactez-nous pour organiser une session intra-entreprise.

Réservation & Renseignements

Téléphone : +212 522 247 210
Email : contact@innov-maroc.com
Web : https//www.innov-maroc.com

INNOV MAROC

INNOV MAROC — Tous droits réservés