

Cycle Risk Management

Lien : https://innov-maroc.com/formation/cycle-risk-management

DURÉE	RÉFÉRENCE	CATÉGORIE
5 jours (35h)	**MRL34**	**Risk Management**

OBJECTIFS DE LA FORMATION

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

- Préciser le cadre économique et règlementaire du Risk Management dans le secteur financier
- Identifier les différentes sources de risque
- Maîtriser les mesures de risques en banque et en asset management
- Assimiler les techniques de modélisation avancée des risques

INNOV MAROC

POUR QUI ?

- Risk managers banque, assurance, asset managers et institutionnels
- Personnel de la fonction IT
- Analystes risques
- Analystes quantitatifs
- Contrôleurs
- Managers middle office et leurs collaborateurs, toutes entités
- Auditeurs
- Senior bankers
- Banquiers privés

INNOV MAROC



Programme détaillé

1 / Introduction au risk management

- Notions de risque et de facteurs de risque
- Les divers types de risques
- Risque de marché
- Risque de crédit
- Risque de liquidité
- Risque opérationnel
- Organisation et mise en place du risk management
- Dispositif interne et aspects opérationnels
- Exigences réglementaires
- Liens entre capital économique et réglementaire
- Concept d’appétence au risque, mesures qualitatives et quantitatives
- Le processus de management des risques : identification, mesure, management

2 / Les mesures pour le risque de marché

- Typologie des facteurs de risque de marché
- Sensibilités : le cas des forwards, des options
- VAR paramétrique, historique, Monte-Carlo
- Expected Shortfall
- Problèmes d’estimation
- Backtests et stress-tests

INNOV MAROC

3 / Les mesures pour le risque de crédit

- Méthode historique : la notation des contreparties, les agences de rating
- Approches structurelles : Merton, KMV
- Approche marché : estimation des probabilistes de défaut à partir des prix des CDS et/ou des obligations
- Le risque de contrepartie : quantification (CVA), management, environnement règlementaire

4 / Le risque de liquidité

- Spécificités des classes d'actifs en termes de liquidité
- Liquidité funding vs liquidité transactionnelle
- Les sources du risque de liquidité
- Le management du risque : gaps, stress tests, plan de contingence

5 / Mesure et gestion du risque opérationnel

- Typologie des risques opérationnels
- Risques frontières
- Méthodologie d'allocation des fonds propres
- Dispositif de gestion et suivi du risque opérationnel
- Démarche de gestion du risque opérationnel
- Analyse qualitative : identification des processus, cartographie et cotation des risques et des contrôles associés
- Analyse quantitative : Pilotage et suivi du risque opérationnel
- Pilotage et suivi du risque opérationnel

6 / Les risques extrêmes

- Value-at-Risk : fondements et premières formalisations
- Fondements de la VaR
- Premières formalisations
- Value-at-Risk et Théorie des Valeurs Extrêmes
- Théorie des Valeurs Extrêmes

INNOV MAROC

- Application à la Value-at-Risk

7 / Les risques multiples

- Définition et propriétés des copules
- Définition
- Propriétés
- Exemples de copules
- Mise en œuvre des copules
- Méthodes de simulation
- Méthodes d’inférence statistique
- Modélisation de la probabilité de défaut
- Approche par les ratings
- Modèle de Merton
- Modèle à intensité constante
- Modélisation du taux de recouvrement
- Mesure du taux de recouvrement
- Modélisation stochastique et calibration
- Modélisation de la dépendance des défauts
- Mesurer la dépendance des événements de défaut
- Copules et dépendance des défauts
- CreditVaR

INNOV MAROC

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

23 au 27 Nov. 2026	Distanciel
25 au 29 Jan. 2027	Présentiel - Casablanca
22 au 26 Mars 2027	Présentiel - Casablanca
17 au 21 Mai 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 16 Juil. 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 — Tous droits réservés

INNOV MAROC