



Dérivés de Crédit : Pricing Avancé et Stratégies de Gestion du Risque de Crédit

Lien :
<https://innov-maroc.com/formation/derives-de-credit-pricing-avance-et-strategies-de-gestion-du-risque-de-credit>

 DURÉE
5 jours (35h)

 RÉFÉRENCE
FA70

 CATÉGORIE
Finance de Marché

🎯 OBJECTIFS DE LA FORMATION

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

- ✓ Comprendre le fonctionnement des dérivés de crédit
- ✓ Identifier les principaux instruments de crédit dérivés
- ✓ Maîtriser les mécanismes des Credit Default Swaps (CDS)
- ✓ Comprendre les modèles de pricing des dérivés de crédit
- ✓ Évaluer le risque de crédit et de contrepartie
- ✓ Appliquer les modèles de valorisation avancés
- ✓ Développer des stratégies de couverture du risque de crédit
- ✓ Analyser les marchés de dérivés de crédit
- ✓ Comprendre les impacts réglementaires sur ces produits
- ✓ Utiliser les CDS dans la gestion de portefeuille
- ✓ Développer des compétences en ingénierie financière
- ✓ Maîtriser les techniques de gestion du risque financier

👥 POUR QUI ?

- ✓ Traders et structurers en produits dérivés
- ✓ Analystes financiers et gestionnaires de risque
- ✓ Banquiers d'investissement
- ✓ Responsables de gestion obligataire et crédit
- ✓ Risk managers et contrôleurs des risques
- ✓ Trésoriers d'entreprise et institutions financières
- ✓ Professionnels des banques d'investissement
- ✓ Toute personne impliquée dans la gestion du risque de crédit



Programme détaillé

1 / Introduction aux dérivés de crédit

- Définition des dérivés de crédit (CDS, CLN, etc.)
- Rôle des dérivés de crédit dans les marchés financiers
- Utilité pour la gestion du risque de crédit

2 / Typologie des dérivés de crédit

- Credit Default Swaps (CDS)
- Credit Linked Notes (CLN)
- Collateralized Debt Obligations (CDO)

3 / Mécanisme de fonctionnement des CDS

- Structure d'un CDS (acheteur, vendeur de protection)
- Événements de crédit
- Paiements et déclenchement du contrat

4 / Notions fondamentales de pricing

- Probabilité de défaut et taux de recouvrement
- Spread de crédit et prime de risque
- Modèles de valorisation des CDS

5 / Modèles de pricing avancés

- Approche hazard rate (intensité de défaut)
- Modèles stochastiques du risque de crédit
- Calibration des modèles aux marchés

6 / Gestion du risque de crédit

- Couverture du risque via CDS
- Mesure du risque de contrepartie
- Stress testing et scénarios de défaut

7 / Marché des dérivés de crédit

- Acteurs principaux du marché
- Liquidité et profondeur de marché
- Évolution post-crise financière

8 / Réglementation et cadre prudentiel

- Règles Bâle III et exigences de capital
- Transparence et reporting des dérivés
- Réformes post-crise des CDS

9 / Stratégies d'utilisation des dérivés de crédit

- Hedging de portefeuille obligataire
- Arbitrage de crédit
- Spéculation et gestion active

10 / Études de cas et applications pratiques

- Analyse de CDS sur entreprises réelles
- Crises de crédit et impact des dérivés

- Construction de 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

 05 au 09 Oct. 2026

 Présentiel - Casablanca

 30 Nov. au 04 Déc. 2026

 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>