

Perfectionnement Risk Management

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

DURÉE	RÉFÉRENCE	CATÉGORIE
3 jours (21h)	**MRL36**	**Risk Management**

OBJECTIFS DE LA FORMATION

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

- Assimiler les techniques de modélisation avancée des risques

POUR QUI ?

- Toute personne au profil plutôt scientifique évoluant dans le domaine financier souhaitant aller plus loin sur la mesure des risques financiers

INNOV MAROC



Programme détaillé

1 / 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

2 / 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
- Application à la Value-at-Risk

3 / Les risques multiples

- Définition et propriétés des copules
- Définition

INNOV MAROC

- 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

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

INNOV MAROC

Prochaines dates programmées

20 au 22 Jan. 2027	Présentiel - Casablanca
17 au 19 Mars 2027	Présentiel - Casablanca
12 au 14 Mai 2027	Présentiel - Casablanca
07 au 09 Juil. 2027	Présentiel - Casablanca
08 au 10 Sep. 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