

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

Lien : https://maroc-performance.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

Maroc Performance

🎯 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

Maroc Performance



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

Maroc Performance

- 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

Maroc Performance

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

30 Nov. au 04 Déc. 2026	Présentiel - Casablanca
22 au 26 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
19 au 23 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
14 au 18 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
09 au 13 Août 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@maroc-performance.com
Web : https//www.maroc-performance.com

Maroc Performance — Tous droits réservés