

Fondamentaux Risk Management

Lien : https://maroc-performance.com/formation/fondamentaux-risk-management

DURÉE
3 jours (21h)

RÉFÉRENCE
MRL35

CATÉGORIE
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

Maroc Performance

👥 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

Maroc Performance



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

3 / Les mesures pour le risque de crédit

Maroc Performance

- 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

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

24 au 26 Fév. 2027	Présentiel - Casablanca
21 au 23 Avr. 2027	Présentiel - Casablanca
16 au 18 Juin 2027	Présentiel - Casablanca
18 au 20 Août 2027	Présentiel - Casablanca
20 au 22 Oct. 2027	Présentiel - Casablanca

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

Maroc Performance

Réservation & Renseignements

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

Document généré le 18/11/2026 — Réf : MRL35
Maroc Performance — Tous droits réservés

Maroc Performance