

### PROGRAMME PILOTER ET GÉRER LES OPÉRATIONS ET RISQUES DE MARCHÉS

Identifier les différents mécanismes de la macroéconomie et ses incidences sur ses décisions de gestion.

#### Présentation synthétique.

L'expert en finance de marché analyse les différentes données et évalue les risques afin de déterminer la stratégie d'optimisation des actifs et des investissements. Il traite donc de nombreuses données qui lui permettent d'établir des préconisations. Il peut également être amené à effectuer des transactions. Au sein du front-office de la salle des marchés, son rôle est donc central. Sa réactivité et la rapidité de son analyse représentent de grands atouts décisionnels et ses décisions sur les transactions impactent directement la situation financière de l'institution ou de son client. La présente certification a pour objectif d'apporter les compétences indispensables à l'exercice du métier d'Expert en finance de marché.

#### Modalités de formation :

#### Durée et horaires de la formation

Durée de la Formation : 125h

Certificateur : **ESG**

**Tarifs** : 3 990 EUROS

**Contacts** : CACACE Gregory  
TEL : 04 89 14 58 50 MAIL : [contact@xeilos.fr](mailto:contact@xeilos.fr)  
**Formation en Distanciel**

**Délais d'accès** : Les délais sont de 1 mois à partir de la validation de l'inscription.

**Accessibilité aux personnes en situation de handicap** : Formation accessible aux personnes en situation de handicap. Contact : Gregory CACACE.

# XEILOS

## Centre de Formation

### MARCHÉS FINANCIERS

#### Cette formation a pour but :

- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux
- Concevoir des systèmes pour surveiller et contrôler les risques financiers continuellement.
- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux.
- Utiliser des méthodes quantitatives et des modèles pour évaluer l'impact potentiel des fluctuations de marché sur un portefeuille d'investissements.
- Établir des politiques et procédures pour évaluer et gérer les risques au sein d'un portefeuille ou d'une organisation financière.
- Comprendre et appliquer les réglementations de conformité et les normes de l'industrie.
- Développer des stratégies pour mitiger, transférer ou accepter le risque en fonction de l'appétit au risque de l'entreprise ou des clients.
- Proposer une couverture basée sur l'utilisation de produits dérivés
- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer les risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.
- Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.
- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer les risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.
- Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.

### Public et prérequis

- **Public** : Cette formation s'adresse aux personnes désireuses d'acquérir de la connaissance sur la macroéconomie globale, tant en termes de marchés financiers, marchés et gestion de change que de géopolitique et leurs incidences sur les stratégies de gestion de trésorerie.
- **Prérequis** : N/A

### Objectif de formation

A l'issue de la formation, le stagiaire identifiera les différents mécanismes de la macroéconomie et ses incidences sur ses décisions de gestion.

Séquence 1 : Cartographier les différents risques économiques, opérationnels, financiers, et juridiques.

Séquence 2 : Mesurer l'impact des différents risques pouvant peser sur les résultats de l'entreprise.

Séquence 3 : Établir une stratégie de gestion des risques financiers.

Séquence 4 : Superviser le traitement, et l'enregistrement des opérations de marchés.

Séquence 5 : Concevoir un système de reporting .

### Méthodes et moyens pédagogiques

Voir le programme de formation en annexe détaillant les moyens mis en œuvre pour réaliser techniquement l'action, suivre son exécution et apprécier ses résultats. Une feuille d'émergence signée par le(s) stagiaire(s) et le formateur, par demi-journée de formation, permettra de justifier de la réalisation de la prestation.

#### Méthodes pédagogiques :

- Méthode pédagogique expositive
- Méthode pédagogique active
- Méthode pédagogique participative

#### Moyens pédagogiques :

- Simulation
- Cas pratique
- Exercices
- Questionnaires

#### Ressources pédagogiques

- Supports de cours en PDF
- Supports vidéos
- Programme type

#### Moyens techniques

- Vidéoprojecteur

# XEILOS

## Centre de Formation

- Ordinateur connecté à internet
- Paperboard
- Cloud
- Vidéos préenregistré
- Espace personnel sur site internet

### Le formateur / La formatrice

Les formateurs détiennent un MAGISTERE BANQUE FINANCE ASSURANCE de l'Université Paris Dauphine.

### Accompagnement et suivi du stagiaire :

Le stagiaire est accompagné par le formateur du début à la fin de la formation.  
Un suivi régulier permet d'ajuster si besoin les compétences abordées tout au long de la formation.

### Dispositif d'évaluation en début de formation :

- Quiz de démarrage.

### Dispositif d'évaluation pendant la formation pendant la formation

Séquence 1 : Cartographier les différents risques économiques, opérationnels, financiers, et juridiques.  
Séquence 2 : Mesurer l'impact des différents risques pouvant peser sur les résultats de l'entreprise.  
Séquence 3 : Établir une stratégie de gestion des risques financiers.  
Séquence 4 : Superviser le traitement, et l'enregistrement des opérations de marchés.  
Séquence 5 : Concevoir un système de reporting .

### Dispositifs d'évaluation à la fin et après la formation

- Entretien.

### Sanction de la formation

En application de l'article L.6353-1 du Code du Travail, une attestation mentionnant les objectifs, la nature et la durée de l'action et les résultats de l'évaluation des acquis de la formation sera remise au(x) stagiaire(s) à l'issue de la formation.

**Taux de satisfaction : 78%**  
**Taux d'accomplissement : 78%**

### Itinéraire pédagogique

Accueil des stagiaires

Evaluation en début de formation

Séquence 1 : Cartographier les différents risques économiques, opérationnels, financiers, et juridiques.

Validation des acquis : Questionnaire

Séquence 2 : Mesurer l'impact des différents risques pouvant peser sur les résultats de l'entreprise.

Séquence 3 : Établir une stratégie de gestion des risques financiers.

Validation des acquis : Questionnaire

Séquence 4 : Superviser le traitement, et l'enregistrement des opérations de marchés.

Validation des acquis : Questionnaire

Séquence 5 : Concevoir un système de reporting .

Validation des acquis : Questionnaire

Cas pratique.

### Programme détaillé

#### PROGRAMME piloter et gérer les opérations et risques de marchés

- Comprendre les risques.
- Outils d'évaluation des risques.

- Risques économiques.
- Risques Opérationnels.
- Risques financiers.
- Risques Juridiques.
- Qualification des risques et cartographie des risques.
- Suivi des Risques et Mise à jour de la cartographie.
- Types de risques et mathématiques financières.
- Logiciels Statistiques et Techniques de Modélisation.
- Classification des risques et inventaire des risques.
- Quantification des risques.
- Modèles Stochastiques.
- Mesure de l'Impact sur les Résultats et de la Sensibilité.
- Rapport de Risque.
- Surveillance continue des indicateurs de risque.
- Introduction aux risques financiers.
- Logiciels de modélisation.
- Analyse des tendances.
- Modélisation Paramétrique.
- Couverture avec produits dérivés.
- Mise en œuvre et test.
- Ajuster les paramètres du modèle.
- Documentation et Rapport.
- Comprendre les Obligations Réglementaires.
- Systèmes de Gestion des Opérations de Marché.
- Mise en place du Système de Contrôle Interne.
- Monitoring en temps réel.
- Rapports Réglementaires et Archivage des Données.
- Audits Internes et Mises à Jour Réglementaires.
- Formation des équipes et évaluation des compétences.
- Évaluation des besoins et objectifs.
- Conception du Tableau de bord.
- Collecte et traitement des données.
- Vérification et synthèse des données.
- Création des Rapports et Automatisation du Reporting.

- Conformité et Sécurité.
- Révision et l'amélioration continue du système.

### Cours général

#### 1. Évaluation des risques de marchés

##### **Phase 1: Comprendre les Risques**

###### **1. Types de Risques**

- Étude des différents types de risques: économiques, opérationnels, financiers et juridiques.

###### **2. Importance des Risques**

- Comprendre comment chaque type de risque peut impacter l'entreprise.

##### **Phase 2: Outils et Méthodologies**

###### **1. Outils d'Évaluation des Risques**

- Familiarisez-vous avec les outils comme les matrices de risques, SWOT, et les logiciels de gestion des risques.

###### **2. Méthodologies**

- Apprendre des méthodologies pour évaluer et qualifier les risques (ex: ISO 31000).

##### **Phase 3: Risques Économiques**

###### **1. Évaluation Macroéconomique**

- Analyser les indicateurs économiques et leur impact potentiel sur l'entreprise.

###### **2. Risques du Marché**

- Évaluer la volatilité et autres facteurs de risque du marché.

###### **1. Phase 4: Risques Opérationnels**

###### **2. Processus Internes**

- Examiner les processus opérationnels pour identifier les vulnérabilités.

###### **3. Ressources Humaines**

- Évaluer les risques liés à la gestion du personnel.

##### **Phase 5: Risques Financiers**

###### **1. Risques de Crédit et de Liquidité**

- Analyse des risques associés aux crédits et à la liquidité.

**2. Exposition aux Devises et Taux d'Intérêt**

- o Évaluer les risques financiers liés aux fluctuations des taux de change et des taux d'intérêt.

**Phase 6: Risques Juridiques****1. Contrats et Conformité**

- o Examiner les contrats et les obligations légales pour évaluer les risques juridiques.

**2. Propriété Intellectuelle**

- o Évaluer les risques liés à la propriété intellectuelle et autres actifs intangibles.

**Phase 7: Qualification et Cartographie****1. Qualification des Risques**

- o Utiliser une matrice de risques pour qualifier le niveau de criticité de chaque risque identifié.

**2. Cartographie des Risques**

- o Créer une cartographie visuelle pour représenter le spectre des risques et leur impact sur l'entreprise.

**Phase 8: Suivi et Mise à Jour****1. Suivi des Risques**

- o Mettre en place un système de suivi pour monitorer l'évolution des risques.

**2. Mise à Jour de la Cartographie**

- o Actualiser régulièrement la cartographie en fonction des changements dans l'entreprise ou son environnement.

**2. Évaluation des risques de marchés****Phase 1: Fondements et Concepts****1. Types de Risques**

- o Comprendre les différents types de risques auxquels une entreprise peut être confrontée (risque de marché, de crédit, opérationnel, etc.).

**2. Mathématiques Financières**

- o Acquérir des bases solides en statistiques et en mathématiques financières pour évaluer les risques.

**Phase 2: Outils et Technologies****1. Logiciels Statistiques**

- o Apprendre à utiliser des logiciels comme R, SAS ou Python pour les analyses statistiques.

**2. Techniques de Modélisation**



- o Se familiariser avec les méthodes de modélisation des risques comme le Monte Carlo.

### Phase 3: Identification des Risques

#### 1. Inventaire des Risques

- o Identifier tous les risques potentiels qui pourraient affecter l'entreprise.

#### 2. Classification des Risques

- o Classer les risques en fonction de leur impact potentiel et de la probabilité de survenue.

### Phase 4: Quantification des Risques

#### 1. Mesure Statistique

- o Utilisez des méthodes statistiques pour quantifier le niveau de chaque risque identifié.

#### 2. Indicateurs Clés

- o Établir des indicateurs clés de performance (KPI) liés au risque pour une surveillance continue.

### Phase 5: Modélisation et Simulation

#### 1. Modèles Stochastiques

- o Utiliser des modèles stochastiques pour simuler différents scénarios de risque.

#### 2. Test de Résilience

- o Effectuer des tests de résilience en utilisant les simulations pour voir comment l'entreprise réagit aux différents scénarios.

### Phase 6: Analyse d'Impact

#### 1. Mesure de l'Impact sur les Résultats

- o Évaluer comment chaque type de risque pourrait affecter les résultats financiers de l'entreprise.

#### 2. Analyse Sensibilité

- o Effectuer une analyse de sensibilité pour évaluer comment de petites variations dans les variables peuvent affecter les résultats.

### Phase 7: Rapport et Communication

#### 1. Rapport de Risque

- o Créer un rapport détaillé sur l'exposition aux risques et les plans d'atténuation.

#### 2. Communication Interne

- o Communiquer efficacement les résultats de l'analyse aux parties prenantes clés de l'entreprise.

### Phase 8: Revue et Ajustement

#### 1. Suivi des Indicateurs

- o Surveiller en continu les indicateurs de risque pour détecter tout changement significatif.
- 2. **Ajustements Stratégiques**
  - o Réviser et ajuster les plans d'atténuation des risques en fonction des résultats du suivi.

### 3. Définition des normes de gestion des risques

1. **Phase 1: Fondations Théoriques**
2. **Introduction aux Risques Financiers**
  - o Comprendre les différents types de risques financiers: marché, crédit, liquidité, etc.
3. **Produits Dérivés**
  - o Apprendre les bases des options, des futures, des swaps et des autres instruments dérivés.

#### **Phase 2: Outils et Ressources**

1. **Logiciels de Modélisation**
  - o Se familiariser avec des outils comme MATLAB, R ou Python pour la modélisation financière.
2. **Sources de Données**
  - o Identifier des bases de données fiables pour les données historiques de marché.

#### **Phase 3: Analyse Historique**

1. **Collecte de Données Historiques**
  - o Collecter des données sur les indices de marché, les taux d'intérêt, etc.
2. **Analyse des Tendances**
  - o Utiliser des techniques statistiques pour analyser les tendances historiques.

#### **Phase 4: Modélisation Paramétrique**

1. **Modèles de Volatilité**
  - o Apprendre à utiliser des modèles comme GARCH pour estimer la volatilité.
2. **Fonctions Paramétriques**
3. Utiliser des fonctions paramétriques pour estimer des mouvements futurs.

#### **Phase 5: Couverture avec Produits Dérivés**

1. **Stratégies de Couverture**
  - o Comprendre comment utiliser des options et des futures pour la couverture.
2. **Optimisation**

- o Utiliser des techniques d'optimisation pour minimiser le coût de la couverture.

### Phase 6: Mise en Œuvre et Test

#### 1. Simulations

- o Simuler la stratégie de gestion des risques dans différents scénarios de marché.

#### 2. Backtesting

- o Utiliser des données historiques pour vérifier l'efficacité de la stratégie.

### Phase 7: Examen et Ajustement

#### 1. Suivi des Performances

- o Suivre la performance de la stratégie en temps réel.

#### 2. Réajustement

- o Ajuster les paramètres du modèle et la stratégie de couverture selon les performances et les changements du marché.

### Phase 8: Documentation et Rapport

#### 1. Rapports de Performance

- o Créer des rapports détaillés sur l'efficacité de la gestion des risques.

#### 2. Révisions Périodiques

- o Réviser et mettre à jour la stratégie selon les évolutions du marché et les besoins de l'entreprise.

#### 4. Suivi et contrôle des opérations de la salle de marchés

### Phase 1: Fondations et Connaissances

#### 1. Comprendre les Obligations Règlementaires

- o Étudier les lois et règlements qui régissent les opérations de marché au niveau national et international.

#### 2. Bases du Contrôle Interne

- o Comprendre les principes fondamentaux du contrôle interne et de la gestion des risques.

### Phase 2: Outils et Technologies

#### 1. Systèmes de Gestion des Opérations de Marché

- o Familiarisez-vous avec les systèmes de gestion des opérations et les logiciels de contrôle interne.

#### 2. Sélection de Plateformes

- o Choisir des plateformes qui permettent un suivi réglementaire efficace et des fonctionnalités de reporting.

### Phase 3: Mise en Place du Système de Contrôle Interne

#### 1. Identification des Risques

- o Établir un inventaire des risques associés aux opérations de marché et à la non-conformité réglementaire.

#### 2. Procédures de Contrôle

- o Établir des procédures de contrôle interne pour gérer ces risques.

### Phase 4: Suivi des Activités

#### 1. Monitoring en Temps Réel

- o Mettre en place un système de surveillance en temps réel des opérations de marché.

#### 2. Alertes et Notifications

- o Configurer des alertes pour les activités suspectes ou non conformes.

### Phase 5: Reporting et Documentation

#### 1. Rapports Réglementaires

- o Établir des modèles de rapports pour répondre aux exigences réglementaires.

#### 2. Archivage des Données

- o Mettre en place un système d'archivage sécurisé pour les données liées aux opérations de marché.

### Phase 6: Revue et Amélioration Continue

#### 1. Audits Internes

- o Effectuer des audits réguliers pour évaluer l'efficacité du système de contrôle interne.

#### 2. Mises à Jour Réglementaires

- o Restez à jour sur les changements législatifs et ajustez les procédures de contrôle en conséquence.

### Phase 7: Formation et Sensibilisation

#### 1. Formation des Équipes

- o Fournir une formation continue aux équipes sur les meilleures pratiques et les mises à jour réglementaires.

#### 2. Évaluation des Compétences

- o Effectuer des évaluations régulières pour s'assurer que l'équipe est compétente dans le respect des obligations réglementaires.

## 5. Conception de systèmes de Reporting

### Phase 1: Évaluation des Besoins et Objectifs

#### 1. Identification des Parties Prenantes

- o Établir qui sont les destinataires des rapports (actionnaires, autorités de marché, etc.)

#### 2. Définition des Objectifs

# XEILOS

## Centre de Formation

- o Déterminer les informations clés à inclure dans le rapport.

### Phase 2: Conception du Tableau de Bord

#### 1. Choix des Indicateurs de Performance (KPI)

- o Sélectionner les KPI pertinents pour mesurer la performance du portefeuille.

#### 2. Design du Tableau de Bord

- o Utiliser des logiciels comme Tableau, Power BI, ou Excel pour créer un tableau de bord visuellement attrayant et informatif.

### Phase 3: Collecte et Traitement des Données

#### 1. Identification des Sources de Données

- o Trouver les bases de données ou les flux de données pour les KPIs choisis.

#### 2. Automatisation de la Collecte

- o Mettre en place des scripts ou utiliser des APIs pour collecter les données automatiquement.

### Phase 4: Analyse et Synthèse

#### 1. Vérification des Données

- o Assurez-vous que les données collectées sont précises et complètes.

#### 2. Synthèse des Données

- o Utiliser des techniques statistiques pour synthétiser les données en insights actionnables.

### Phase 5: Création des Rapports

#### 1. Rédaction du Rapport

- o Compiler les insights dans un rapport complet, incluant des graphiques et des tableaux.

#### 2. Automatisation du Reporting

- o Utiliser des logiciels ou des scripts pour automatiser la création et la Distribution des rapports.

### Phase 6: Conformité et Sécurité

#### 1. Vérification de la Conformité

- o Assurer que les rapports sont en conformité avec les normes réglementaires.

#### 2. Mesures de Sécurité

- o Implémenter des mesures de sécurité pour protéger les données sensibles.

### Phase 7: Revue et Amélioration

#### 1. Feedback des Parties Prenantes

- o Solliciter des retours des destinataires des rapports pour améliorer les versions futures.

#### 2. Révision Périodique

- o Revoir régulièrement les KPIs, les sources de données, et les méthodes d'analyse pour s'assurer qu'ils restent pertinents et à jour.

Validation des acquis :

- Questionnaire
- Entretien

