

# GESTION DES RISQUES DE MARCHE DANS UNE BANQUE CENTRALE

1-4 DECEMBRE 2015

## Objectif

Ce séminaire a pour objectif de présenter les principaux risques de crédit, de change et de taux auxquels sont confrontés les banques centrales et les autorités de supervision. Les participants aborderont les mesures d'évaluation des instruments de crédit, Forex et Or, ainsi que des produits de taux. Les experts de la Banque de France présenteront les mesures d'évaluation des risques associés à ces instruments, la méthodologie de la value at risk et les modèles de risque de défaut.

## Participants

Ce séminaire s'adresse à des agents des directions de gestion des risques, des opérations de marché et des directions des études économiques et financières des banques centrales.

## Contenu

Les thèmes suivants seront abordés :

- Connaître et « pricer » les instruments de crédit, les instruments Forex et Or, les produits de taux
- Interpréter les différentes mesures du risque de crédit
- Aborder les différents types de taux et les indicateurs de risque de marché
- Maîtriser le concept de VaR (Value at Risk), effectuer des calculs de VaR
- Modélisation du risque de défaut

## Durée

4 jours

## Date limite d'inscription

5 octobre 2015

## Langue

Français / Anglais avec traduction simultanée

## Lieu

Paris

## Responsables du séminaire

Hedi JEDDI

## Adresse de contact

[Marketrisk15@banque-france.fr](mailto:Marketrisk15@banque-france.fr)

## Inscription en ligne

<https://www.banque-france.fr/eurosysteme-et-international/ibfi-institut-bancaire-et-financier-international/informations-pratiques/fiche-dinscription.html>