

# Modélisation des risques financiers de l'entreprise

Cours Pratique de 2 jours - 14h

Réf : MFI - Prix 2024 : nous consulter

Les techniques de modélisation permettent d'anticiper les risques financiers de l'entreprise, d'éclairer les choix dans un environnement incertain et d'assurer la rentabilité des investissements. Cette formation vous présente de nouvelles méthodologies de décision, plus proches de la réalité de l'entreprise.

## OBJECTIFS PÉDAGOGIQUES

À l'issue de la formation l'apprenant sera en mesure de :

Distinguer les différents types de risques pour l'entreprise

Appliquer des méthodes de modélisation des risques financiers

Déterminer la méthode d'analyse la plus adaptée à la situation de son entreprise

## TRAVAUX PRATIQUES

Apports théoriques et exercices pratiques de calculs et d'analyses des risques. Echanges autour de retours d'expériences et de bonnes pratiques.

## LE PROGRAMME

dernière mise à jour : 09/2021

### 1) Diagnostiquer l'existant

- Les outils de calcul financier : valeur actuelle et taux de rendement interne.
  - Analyser les modalités de calcul de la valeur terminale.
  - Analyser les hypothèses liées aux prévisions.
  - Analyser les hypothèses associées aux calculs du coût des capitaux.
  - Appliquer le modèle d'évaluation par Discounted Cash Flow.
- Travaux pratiques : Calculs de différentes valeurs financières selon plusieurs hypothèses.*

### 2) Appréhender la modélisation des différents types de risques

- Identifier les risques via les facteurs de risques.
  - Analyser les sensibilités.
  - Découvrir les différentes typologies de risques: de change, de taux, d'hyperinflation, politique...
- Démonstration : Analyse de différents types de risques.*

### 3) Modéliser les risques financiers et comprendre leurs impacts

- Intégrer les risques de taux et les risques de change.
  - Générer les futurs échéanciers.
  - Modéliser les risques de variation du prix des matières premières.
  - Appliquer les modèles de prévisions des flux futurs : prévisions en volume.
  - Modéliser l'inflation : calculs de prix constant et prix courant.
- Travaux pratiques : Analyse et calculs de risques financiers.*

### 4) Explorer différents modèles d'analyse et de calculs des risques

- Value at Risk et Expected Shortfall.
  - Simulations Monte Carlo.
  - Modèles utilisant les formules d'options (BSM) et options réelles.
- Démonstration : Exemples d'applications de différents modèles d'analyse et de calculs des risques.*

## PARTICIPANTS

Dirigeants, membres du Comité de direction, cadres financiers et de gestion.

## PRÉREQUIS

Bonnes connaissances en gestion d'entreprise.

## COMPÉTENCES DU FORMATEUR

Les experts qui animent la formation sont des spécialistes des matières abordées. Ils ont été validés par nos équipes pédagogiques tant sur le plan des connaissances métiers que sur celui de la pédagogie, et ce pour chaque cours qu'ils enseignent. Ils ont au minimum cinq à dix années d'expérience dans leur domaine et occupent ou ont occupé des postes à responsabilité en entreprise.

## MODALITÉS D'ÉVALUATION

Le formateur évalue la progression pédagogique du participant tout au long de la formation au moyen de QCM, mises en situation, travaux pratiques...

Le participant complète également un test de positionnement en amont et en aval pour valider les compétences acquises.

## MOYENS PÉDAGOGIQUES ET TECHNIQUES

- Les moyens pédagogiques et les méthodes d'enseignement utilisés sont principalement : aides audiovisuelles, documentation et support de cours, exercices pratiques d'application et corrigés des exercices pour les stages pratiques, études de cas ou présentation de cas réels pour les séminaires de formation.
- À l'issue de chaque stage ou séminaire, ORSYS fournit aux participants un questionnaire d'évaluation du cours qui est ensuite analysé par nos équipes pédagogiques.
- Une feuille d'émargement par demi-journée de présence est fournie en fin de formation ainsi qu'une attestation de fin de formation si le stagiaire a bien assisté à la totalité de la session.

## MODALITÉS ET DÉLAIS D'ACCÈS

L'inscription doit être finalisée 24 heures avant le début de la formation.

## ACCESSIBILITÉ AUX PERSONNES HANDICAPÉES

Vous avez un besoin spécifique d'accessibilité ? Contactez Mme FOSSE, référente handicap, à l'adresse suivante psh-accueil@orsys.fr pour étudier au mieux votre demande et sa faisabilité.

#### 5) Perspectives d'extension de la modélisation

- La modélisation des bilans comptables et du compte d'exploitation.
- La prise en compte de la fiscalité.
- Le ratio de choix d'investissement

*Réflexion collective* : Echanges sur l'utilisation de modèles d'analyse financière.

## LES DATES

---

Nous contacter