

RISQUES

TRAITER SUR LES MARCHÉS FINANCIERS

Apprenez à parler le langage des marchés pour mieux dialoguer avec vos banquiers! Cette formation vous familiarise avec le vocabulaire et les pratiques des salles de marché. À travers des mises en situation concrètes, vous apprendrez à lire une page de cotation, formuler une demande claire, comprendre les produits proposés (spots, swaps, options, caps, etc.) et éviter les principaux pièges. Une formation essentielle pour négocier efficacement et en toute confiance avec ses partenaires financiers.

COMPÉTENCES VISÉES

- S'initier au traitement des opérations sur les marchés de taux ou de change
- Connaître le vocabulaire technique des opérateurs et apprendre à le maîtriser par des exercices de mise en situation

PROGRAMME

LE VOCABULAIRE DE BASE

LES MARCHÉS ET LES INTERVENANTS

- L'organisation des marchés : OTC vs marché organisé
- Les cotations et la rémunération des intervenants

- Rappel des concepts techniques
 - Delta, gamma et vega
 - La nouvelle réglementation en matière de risque de contrepartie : collatéralisation et CVA

LES TECHNIQUES DE NÉGOCIATION SUR LES MARCHÉS

- La détermination du sens de l'opération
- La lecture et l'interprétation des pages d'information financière
- La définition à l'avance des paramètres des opérations
- Les pièges à éviter
- Les plates-formes de *trading* électroniques

Jeux de rôles

- Demande de cotations d'opérations au comptant avec calcul des impacts en P&L
- Demande d'options de change simples et complexes (vanilles, tunnels, *K1 forwards*...)
- Demande de cotations d'instruments de couverture de taux d'intérêt (*swaps, caps, collars* et *K1 forwards, swaptions*)

LES PRODUITS

- Les produits de change
 - Le *spot*
 - Les *swaps*
 - Le terme
 - Les options
- Les produits de taux
 - Les conventions de marché
 - Les FRA
 - Les *swaps* de taux
 - Les *cross currency swaps*
 - Les options
 - Les *swaptions*
 - Les *credit default swaps*



1 jour (7 heures)
PRÉSENTIEL OU
DISTANCIEL

- ▶ 19/06/2026
- ▶ 25/11/2026



Certificat / Parcours
Gestion des risques de
change et de taux
Page 66



Adhérent
885 € HT
Non-adhérent
980 € HT
Repas offert



Public concerné
Toute personne
souhaitant s'impliquer
ou améliorer ses
pratiques de la
négociation des
instruments de
couverture auprès de
son banquier



Prérequis
Pas de prérequis



**Moyens pédagogiques
et d'évaluation**
- Jeux de rôle
- Activités digitales
- Rapport
d'auto-évaluation



Profil formateur(s)
Binôme avec un
trader de dérivés
dans un groupe
bancaire de référence
et un consultant
et ex trésorier d'un
grand groupe
industriel français
qui accompagne les
entreprises dans la
gestion des risques
financiers.