

# GESTION DES RISQUES DE CHANGE ET TAUX CPF<sup>1</sup>



**6 jours** (42 heures)  
PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL



**Adhérent**  
3 825 € HT  
**Option certifiante :**  
765 € HT

**Non-adhérent**  
4 780 € HT  
**Option certifiante :**  
995 € HT

Repas compris



**Public concerné**  
Tout professionnel appartenant à un département trésorerie, comptabilité ou finance et souhaitant développer cette compétence complémentaire en matière de gestion des risques de change et de taux



**Modalités pédagogiques et d'évaluation**  
- Activités digitales  
- Rapport d'auto-évaluation  
- Examen pour option certifiante



**Prérequis**  
Justifier d'un niveau bac + 2 en finance ou contrôle de gestion, avec ou sans spécialisation trésorerie ou d'une expérience professionnelle de 2 ans dans un service financier, trésorerie, contrôle de gestion ou comptabilité des opérations financières et sur entretien préalable à l'entrée d'une formation certifiante d'évaluation des prérequis

## COMPÉTENCES VISÉES

L'acquisition des connaissances et des pratiques professionnelles suivantes :

- Évaluer l'exposition au risque de change de tous les flux et de toutes les positions bilancielles de l'entreprise qui ne sont pas dans sa devise de compte et au risque de taux
- Arbitrer le choix des outils de couverture des risques de change et de taux
- Négocier avec les banques de l'entreprise les instruments financiers de couverture de change et de taux, fermes ou optionnels sélectionnés
- Mettre en place un suivi des instruments fermes ou optionnels de couverture des risques de change et de taux et des sous-jacents couverts

## PROGRAMME

- Les outils de gestion du risque de change : l'identification du risque, les instruments de couverture de ce risque (NDF, *swaps* de change, contrats futurs du CME et options), le *reporting* dans son environnement comptable
- Les outils de gestion du risque de taux : l'identification du risque, les instruments de couverture de ce risque (FRA, *swaps*, *caps*, *floors*, tunnels et *swaptions*) et le *reporting* dans son environnement comptable

FORMATIONS ASSOCIÉES	DATES SESSIONS		PAGE
Traiter sur les marchés financiers	22/06/2023	23/11/2023	66
Comprendre et gérer le risque de change	30, 31/05 et 01/06/2023	10, 11 et 12/10/2023	68
Comprendre et gérer le risque de taux	20 et 21/06/2023	21 et 22/11/2023	72
Dates d'examen	05/07/2023	10/01/2024	

## CERTIFICAT

- Ce cycle peut s'accompagner d'un examen de 3 heures aboutissant à l'obtention du certificat professionnel de spécialisation "Gestion des risques de change et taux"
- Métiers visés : trésorier front-office, opérateur de marché

<sup>1</sup> RS 6180 - Validité 14/12/2025