

RISQUES **CPF**¹

GESTION DES RISQUES DE CHANGE ET DE TAUX

Préparez-vous à valider les compétences clés recherchées par les entreprises grâce au certificat Gestion des risques de change et de taux ! Cette certification vous ouvre les portes de métiers à haute valeur ajoutée : - Operateur marché - Trésorier front office
 Donnez de la valeur à votre expertise et sécurisez votre évolution professionnelle avec les certificats AFTE !

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 bilancielle 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

Nota : le contenu détaillé est précisé dans chaque formation le composant

FORMATIONS ASSOCIÉES	DATES SESSIONS		PAGE
Comprendre et gérer le risque de change	05, 06 et 07/05/2026	13, 14 et 15/10/2026	70
Comprendre et gérer le risque de taux	09 et 11/06/2026	17 et 19/11/2026	67
Traiter sur les marchés financiers	19/06/2026	25/11/2026	71
Dates d'examen	03/07/2026	15/12/2026	

EXAMEN

- 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**

7 jours (49 heures)

PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL



Certificat / Parcours



Adhérent

4 350 € HT

Option certifiante :
400 € HT

Non-adhérent

5 950 € HT

Option certifiante :

400 € HT

Repas offert



Public concerné

Toute personne souhaitant faire valider ses compétences en gestion des risques de change et de taux par l'AFTE seul certificateur habilité :
 - Nouvel arrivant dans la fonction
 - Opérateur de marché/trésorier front office
 - Trésorier impliqué dans la gestion/comptabilisation des opérations de couverture



Prérequis

Justifier à minima d'un niveau en BAC+2 en comptabilité, finance, gestion avec ou sans spécialisation trésorerie ou d'une expérience professionnelle de 2 ans dans un service financier, trésorerie, contrôle de gestion ou comptabilité. Entretien préalable à l'entrée en formation



Moyens pédagogiques et d'évaluation

- Examen pour option certifiante



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.

¹ RS 6221 – Validité 25/01/2026 (En cours de renouvellement)