

GESTION DES RISQUES DE CHANGE ET TAUX



5 jours (35 heures)



Adhérent
3 250 € HT
Option certifiante :
765 € HT

Non-adhérent
4 070 € HT
Option certifiante :
995 € HT
Repas compris



Public concerné
Collaborateurs des services financiers ou consultants souhaitant évoluer ou valider leurs acquis dans le domaine de la couverture des risques de change et taux

Financement
Entreprises :
Code 2533 : inventaire
Individuel :
Code 209059 : CPF

COMPÉTENCES VISÉES

L'acquisition des connaissances et des pratiques professionnelles concernant :

- La gestion du risque de change : évaluation de l'exposition au risque, choix d'un outil de couverture en fonction des objectifs définis, mise en place d'un suivi des outils de couverture conforme aux obligations réglementaires
- La gestion du risque de taux : évaluation de l'exposition au risque, choix d'un outil de couverture en fonction des objectifs définis, mise en place d'un suivi des outils de couverture conforme aux obligations réglementaires
- La mise en place des outils de couverture : élaboration d'une demande de cotation, négociation et sélection

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	27/05/2020	21/09/2020	54
Comprendre et gérer le risque de change	10 et 11/06/2020	14 et 15/10/2020	56
Comprendre et gérer le risque de taux	24 et 25/06/2020	25 et 26/11/2020	58
Dates d'examen	08/07/2020	15/12/2020	

OPTION CERTIFIANTE

- 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"
- L'obtention du certificat "Gestion quotidienne et prévisionnelle de trésorerie" est un prérequis