

LA GESTION DES RISQUES

TRAITER SUR LES MARCHÉS 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

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, *KI forwards*...)
- Demande de cotations d'instruments de couverture de taux d'intérêt (*swaps, caps, collars* et *KI forwards, swaptions*)

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

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*

ACTUALITÉS FINTECH

- Exploration des nouvelles solutions digitales disponibles à court ou moyen termes et notamment les plates-formes électroniques (FX All, 360T...)

1 jour (7 heures)
PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL
▶ 13/06/2024
▶ 14/11/2024

Cycle avec option certifiante :
Gestion des risques de change et taux
Page 16

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

Public concerné
Opérateurs de marché, responsables de trésorerie, responsables de *back-office* et auditeurs

Prérequis
Pas de prérequis

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