



1 jour (7 heures)

PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL

► 22/06/2022
► 23/11/2022



Adhérent

850 € HT

Non-adhérent

940 € 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

LA GESTION DES RISQUES

TRAITER SUR LES MARCHÉS FINANCIERS **CPF**

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

ACTUALITÉS FINTECH

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