

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

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

**Adhérent**  
3 980 € HT  
**Option certifiante :**  
795 € HT

**Non-adhérent**  
4 975 € HT  
**Option certifiante :**  
1 035 € 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 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

FORMATIONS ASSOCIÉES	DATES SESSIONS		PAGE
Traiter sur les marchés financiers	12/06/2025	14/11/2025	64
Comprendre et gérer le risque de change	13, 14 et 15/05/2025	14, 15 et 16/10/2025	66
Comprendre et gérer le risque de taux	10 et 11/06/2025	12 et 13/11/2025	67
Dates d'examen	03/07/2025	18/12/2025	

## 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