



7 jours (49 heures)

**PRÉSENTIEL
OU DISTANCIEL****Certificat / Parcours****Adhérent**

4 380 € 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.

RISQUES CPF¹

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 bilanciels 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	11, 12 et 13/09/2027	12, 13 et 14/10/2027	64
Comprendre et gérer le risque de taux	08, 09 et 10/06/2027	16, 17 et 18/11/2027	62
Traiter sur les marchés financiers	17/06/2027	24/11/2027	66
Dates d'examen	30/06/2027	16/12/2027	

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**

¹ RS 7440 – Validité 18/12/2028