



1 jour (7 heures)

**PRÉSENTIEL OU
DISTANCIEL**

- 17/06/2027
- 24/11/2027


Certificat / Parcours
Gestion des risques de
change et de taux
Page 62

Adhérent

885 € HT

Non-adhérent

980 € HT

Repas offert


Public concerné

Toute personne souhaitant
s'impliquer ou améliorer ses
pratiques de la négociation
des instruments de
couverture auprès de son
banquier

Prérequis

Culture financière


**Moyens pédagogiques
et d'évaluation**

- Jeux de rôle
- Activités digitales
- Rapport d'auto-évaluation


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
TRAITER SUR LES MARCHÉS FINANCIERS

Apprenez à parler le langage des marchés pour mieux dialoguer avec vos banquiers! Cette formation vous familiarise avec le vocabulaire et les pratiques des salles de marché. À travers des mises en situation concrètes, vous apprendrez à lire une page de cotation, formuler une demande claire, comprendre les produits proposés (spots, swaps, options, caps, etc.) et éviter les principaux pièges. Une formation essentielle pour négocier efficacement et en toute confiance avec ses partenaires 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

- Rappel des concepts techniques

- Delta, gamma et vega

- La nouvelle réglementation en matière de risque de contrepartie : collatéralisation et CVA

LES MARCHÉS ET LES INTERVENANTS

- L'organisation des marchés :
OTC vs marché organisé
- Les cotations et la rémunération
des intervenants

**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