



5 jours (35 heures)



Adhérent :

3 250 € HT

Option certifiante : 765 € HT

Non-adhérent :

4 070 € HT

Option certifiante : 995 € HT

Repas compris



Public concerné :

Collaborateurs des services financiers ou consultants souhaitant évoluer ou valider leurs acquis dans le domaine de la couverture des risques de change et taux

Financement :

Entreprises :

Référencement à l'inventaire CNCP (code : 2533)

Individuel :

Référencement au Compte Personnel de Formation (CPF) sur la liste nationale interprofessionnelle

GESTION DES RISQUES DE CHANGE ET TAUX

COMPÉTENCES VISÉES

L'acquisition des connaissances et des pratiques professionnelles concernant :

- La gestion du risque de change : évaluation de l'exposition au risque, choix d'un outil de couverture en fonction des objectifs définis, mise en place d'un suivi des outils de couverture conforme aux obligations réglementaires
- La gestion du risque de taux : évaluation de l'exposition au risque, choix d'un outil de couverture en fonction des objectifs définis, mise en place d'un suivi des outils de couverture conforme aux obligations réglementaires
- La mise en place des outils de couverture : élaboration d'une demande de cotation, négociation et sélection

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	18/05/2018	21/11/2018	44
Les outils de gestion du risque de change	06 et 07/03/2018	03 et 04/10/2018	45
Les outils de gestion du risque de taux	09 et 10/04/2018	07 et 08/11/2018	46
Dates d'examen	28/06/2018	12/12/2018	

OPTION CERTIFIANTE

- 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"
- L'obtention du certificat "Gestion quotidienne et prévisionnelle de trésorerie" est un prérequis