


# GESTION DES RISQUES DE CHANGE ET TAUX CPF

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

 **Adhérent**  
3 825 € HT  
**Option certifiante :**  
765 € HT

**Non-adhérent**  
4 780 € 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

 **Modalités pédagogiques et d'évaluation**  
- Activités digitales  
- Rapport d'auto-évaluation  
- Examen pour option certifiante

## 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	22/06/2022	23/11/2022	52
Comprendre et gérer le risque de change	31/05 et 01, 02/06/2022	03, 04 et 05/10/2022	54
Comprendre et gérer le risque de taux	20 et 21/06/2022	21 et 22/11/2022	58
Dates d'examen	06/07/2022	15/12/2022	

## 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
- Métiers visés : responsable salle des marchés, opérateur de marché