



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 :

Code 2533 : inventaire

Individuel :

Code 209059 : CPF

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	29/05/2019	28/11/2019	56
Les outils de gestion du risque de change	13 et 14/03/2019	01 et 02/10/2019	57
Les outils de gestion du risque de taux	02 et 03/04/2019	13 et 14/11/2019	58
Dates d'examen	17/06/2019	15/01/2020	

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