

Appliquer les bases des mathématiques financières à la gestion financière

Code
1139

Durée
Sur mesure / 7 heures

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

PUBLIC

Nouveaux entrants - Tout collaborateur de banque, d'assurance ou d'institution financière souhaitant s'initier à ce domaine

PRÉ-REQUIS

Aucun prérequis nécessaire

NIVEAU D'EXPERTISE

Fondamentaux

MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
 - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service
 - ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail

Objectifs pédagogiques

- Actualiser et capitaliser des taux d'intérêt dans le respect des pratiques et conventions
- Evaluer et analyser les obligations
- Calculer les sensibilités des produits de taux

Programme de la formation

Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur recevra vos objectifs de progrès.

Les taux d'intérêt

- Notion de taux d'intérêt
- Intérêts simples et intérêts composés
- Intérêts précomptés et intérêts post-comptés
- TP Excel : calcul d'intérêts simples et composés

Les bases du calcul actuariel

- Capitalisation et actualisation
- Valeur actuelle d'une série de flux futurs
- Valeur Actuelle Nette (VAN) et Taux de Rendement Interne (TRI) d'une stratégie d'investissement
- TP Excel : calcul de VAN et TRI sur des projets d'investissement

Prêts / emprunts : les différents types d'amortissement et calcul du TEG

- Annuités constantes
- Amortissement linéaire
- Amortissement in fine
- Le taux annuel effectif global (TAEG) d'un emprunt
- TP Excel : construction de tableaux d'amortissement et calculs de TAEG

Evaluer les obligations et appréhender leurs risques

- Suivi des présences et remise
- d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : care-formation@lefebvre-dalloz.fr

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

- Qu'est-ce qu'une obligation ?
- Quelles sont ses caractéristiques ?
- Déterminants du prix d'une obligation : risque de taux et risque de crédit
- Rating et spread de crédit
- Taux de rendement actuariel d'une obligation
- Analyse en duration / sensibilité / convexité
- La cotation en pratique : coupon couru, clean price et dirty price
- TP Excel :
- calcul du TRA sur plusieurs obligations
- évaluation de la duration et de la sensibilité d'une obligation de 10 ans
- calcul du coupon couru et du dirty price à partir du cours de l'obligation

Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

A noter

...

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.

