

Produits structurés sur actions : les fondamentaux

Expliquer, utiliser et valoriser les produits structurés

Code
357

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif Inter*
1715 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

PUBLIC

Gérants et assistants gérants actions – Tables de négociation en sociétés de gestion (Institutions side) – Equipes de commercialisation, Banque Privée – Desks de trading et de structuration actions, investors side – Analystes quantitatifs – Managers et collaborateurs de middle et back office titres – Equipes de risk management – Contrôle interne – Equipes IT Capital Markets – Collaborateurs SSII en inter-contrat – Conseillers en Investissements Financiers – CGPI – Cabinets de courtage

PRÉ-REQUIS

Avoir une première approche sur le sujet et une bonne maîtrise d'Excel

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

Objectifs pédagogiques

- Lister les différents types de produits structurés actions et leurs fonctions dans un portefeuille
- Décomposer les produits structurés actions en dérivés vanilles
- Identifier les paramètres de prix et leur impact suivant la nature du produit structuré

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. Auto-évaluez vos compétences pour suivre vos progrès à l'issue de votre formation.

Lister les différents types de produits structurés actions et leurs fonctions dans un portefeuille

Utiliser la brique élémentaire : le dérivé sur actions et indice

- Les options : call, put et leurs paramètres
- Pourquoi un institutionnel utilise des produits dérivés ?

Construire les stratégies optionnelles : mécanismes et objectifs

- Achat et vente d'options
- Call spread, put spread
- Les stratégies à prime nulle
- Les Opals
- Exercices

Décomposer les produits structurés actions en dérivés vanilles

Définir un produit structuré

- Les intervenants : émetteurs et clients
- La construction : combiner plusieurs actifs financiers

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
- 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.

- Pourquoi investir sur ce type de produit ?
- Exercice : comment garantir le capital initial

Combiner les avantages d'un produit obligataire et d'un produit action

- Un outil de diversification ou de couverture
- La fiscalité des produits structurés
- Comment est établi le prix d'un produit structuré
- Pourquoi et comment varie le prix ?
- Cas pratique : comment couvrir le risque

Identifier les paramètres de prix et leur impact suivant la nature du produit structuré

Classer les structurés du marché

- Les produits mono sous-jacents à base d'options vanille ou d'options à barrière, asiatiques, callable...
- Les multi sous-jacents : paniers «Best Of», «Worst Of» et produits à barrière
- Les produits sur fonds, les indexés, les fonds à coussin et CPPI...
- TP Excel : montages simples
- Les swaps de performances, obligations indexées EMTN / BMTN
- Les swaps de type PEA Equity swaps
- Les obligations convertibles et reverse convertibles
- TP Excel : montages complexes

Construire et valoriser les produits structurés

- Dans les coulisses de la structuration
- Quel est l'objectif du structureur ?
- La valeur ajoutée de la structuration
- TP Excel : Vous êtes un structureur, montage de produits structurés de première génération

Lister les produits à base d'options à barrière, asiatiques, callables

- Le pricing : par arbre, par BS, volatilité locale
- Pricing de dérivés vanille et de structurés mono sous-jacents
- Hedging : calcul et analyse des grecques
- TP Excel : Vous êtes un structureur, montage de produits structurés de deuxième génération

Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources, auto-évaluer vos compétences acquises pendant votre formation 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.



Prochaines sessions

...

PARIS

- 14-15 Sep. 2026 - Session Garantie
- 26-27 Nov. 2026

A DISTANCE

- 14-15 Sep. 2026 - Session Garantie
- 26-27 Nov. 2026

