

Intégrer les dérivés fermes et optionnels à son portefeuille pour affiner sa gestion du risque

Code
358

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif Inter*
2 135 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

PUBLIC

Desks commerciaux action (banques, asset managers, institutionnels) – Assistants gérants action et sociétés de gestion, coté investisseurs) – Banquiers privés – Analystes quantitatifs – Managers et collaborateurs de la fonction Middle Office dérivés, dérivés action – Départements valorisation et contrôle – Département Risque – Consultants SSII en inter contrat

PRÉ-REQUIS

Avoir de bonnes connaissances mathématiques et maîtriser l'usage d'Excel

NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

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

Objectifs pédagogiques

- Sélectionner le produit dérivé optimal selon l'objectif
- Adapter l'investissement avec les dérivés aux situations de marché
- Gérer sa performance à l'aide des dérivés listés

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.

Sélectionner le produit dérivé optimal selon l'objectif

Lister les produits classiques

- Utilité et utilisation des dérivés
- Définition d'un future
- Les options : définition d'un call, d'un put
- Les différents intervenants
- Quiz

Analyser les principes des contrats futures

- Type des contrats
- Appel de marge
- Étude de cas : calibrer une position en fonction d'un scénario

Etudier les principes des contrats optionnels

- Les contrats sur action
- Les contrats sur indice
- Les objectifs des options pour la gestion
- Exercice : construction de profil de gain sur mesure et principales propriétés

Adapter l'investissement avec les dérivés aux situations de marché

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.

Utiliser les paramètres

- Volume
- Prix
- Volatilité implicite
- Indice de volatilité
- Smile et skew
- Structure à terme
- Exemples

Utiliser les options

- Calibration d'une position
- Stratégies de couverture
- Stratégies d'amélioration du rendement et de la volatilité
- Étude de cas : gestion de positions

Gérer sa performance à l'aide des dérivés listés

Évaluer les options avec une approche dynamique

- Pourquoi un modèle et l'importance de la dynamique du prix ?
- Précisions sur la valorisation des options européennes et américaines
- Gestion des risques
- Étude de cas : revue des grecques et de leurs utilisations

Approfondir l'analyse

- Probabilités
- Passage du temps et volatilité
- Stratégies en delta neutre et trading de volatilité
- Mise en perspective : les erreurs à éviter et clés pour investir

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

- 2-3 Déc. 2026

A DISTANCE

- 2-3 Déc. 2026

