

Etablir le pricing et la valorisation des dérivés et structurés de change

Code
365

Durée
Sur-mesure / 14 heures

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

PUBLIC

Sales - Risk Managers - Middle et back office Forex - Trésorerie/direction financière entreprise - Gérants OPCVM Internationaux - Banquiers privés - CGP transfrontaliers - Investisseurs exposés à l'international

PRÉ-REQUIS

Avoir une expérience pratique sur le sujet

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

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

Objectifs pédagogiques

- Gérer en sensibilité un portefeuille d'options vanille
- Exploiter les caractéristiques des exotiques de première génération
- Structurer des produits de couverture de risque et d'investissement

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.

Rappels

- Le marché du change
- Détermination du forward
- Options et volatilité
- Parité Put-Call
- TP Excel : parité put-call et valeur temp/cotation d'une option de change
- Exercice : cotation du notionnel et de la prime dans les 2 devises / options américaines / européennes

Pricing et gestion des risques sur option

- Eléments de pricing
- Les sensibilités (Grecques)
- Gestion en delta neutre
- TP Excel : Couverture en delta neutre sur Excel
- P/L du trader et interdépendance des Grecques
- Straddles et strangles

Volatilité, smile et skew

- Volatilité historique
- Volatilité implicite et smile/skew
- Smile et lognormalité
- Smile et dynamique offre/demande

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.

- Smile et volgamma
- Trading du smile : Risk reversals et butterflies

Options exotiques de 1ère génération

- Les options à barrières
- Les digitales
- Autres exotiques de 1ère génération

Applications

- Stratégies de couverture : terme participatif / terme activant / désactivant
- TP Excel : Terme désactivant
- Stratégies d'investissement : dual currency note / dual digital note
- TP Excel : Dual currency note
- Range dépôt
- Range accrual

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.

