

Produits dérivés : les fondamentaux

Spéculer et se couvrir avec les produits dérivés

Code
495

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif Inter*
1715 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

PUBLIC

Equipes de vente (banques, asset managers), négociateurs, banquiers privés, équipes de gestion sous mandat – CIF – CGP – Family office (junior) – Département Risk Management – Fonction risque – Managers et collaborateurs de middle et back office – Comptables – Juristes – Managers et collaborateurs de la fonction IT – Equipes commerciales et Consultants SSII Banque/Assurance en intercontrat – Relation Investisseurs – Marketing et Communication

PRÉ-REQUIS

Aucun prérequis nécessaire mais un « vernis mathématique » est bienvenu

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

- Expliquer les différences économiques et opérationnelles entre dérivés fermes et optionnels, listés et OTC
- Décrire les mécanismes d'exécution et de compensation des dérivés dans le trade workflow
- Valoriser et utiliser un produit dérivé
- Gérer les risques d'un portefeuille avec des produits dérivés

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.

Expliquer les différences économiques et opérationnelles entre dérivés fermes et dérivés conditionnels, listés et OTC

Présenter les produits dérivés sur taux, action, change, crédit et commodities

- Les différences entre marchés organisés et marché de gré à gré

Lister les marchés de produits dérivés

- La réglementation européenne EMIR
- Quiz

Décrire les mécanismes d'exécution et de compensation des dérivés dans le trade workflow

Expliquer ce que représente un dérivé ferme

- Forwards et Futures : principes et utilisations selon les marchés
- Les spécificités du change à terme
- Travaux pratiques (Excel) : calcul de couverture par futures / change à terme

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.

Décomposer les Futures sur actions et indices

- Paramètres définissant le prix d'un Future
- Utilisation d'un Future en mode spéculatif
- Utilisation d'un Future à des fins de couverture
- Exercices d'application

Explorer le monde des Swaps

- Interest Rate Swap (IRS) : mécanismes et utilisations
- Les variantes : Cross Currency Swap (CCS) et swap cambiste
- Travaux pratiques (Excel) : comment fabriquer un prêt à taux fixe

Utiliser les dérivés de crédit en couverture

- Credit Default Swap (CDS) principes et utilisations du produit le plus populaire
- Analyse de confirmation d'une transaction CDS
- Indice iTraxx : à quoi sert-il ?
- Question d'actualité : vers un marché organisé de CDS ?

Utiliser et valoriser un produit dérivé conditionnel

Expliquer les dérivés conditionnels

- Les options, comment ça marche ?
- Les Call et les Put
- Une logique d'assurance face à une logique spéculative
- Paramètres de prix et sensibilités : la mesure du risque
- Les « grecques »
- Exercice : utiliser Excel pour retrouver la logique des Call / Put et des paramètres grecques

Gérer les risques d'un portefeuille avec des produits dérivés

Etablir des stratégies sur les options : couverture ou effet de levier ?

- Les stratégies optionnelles : spread / straddle
- Initiation aux options exotiques
- Les Warrants : un support d'investissement
- Exercice : jouons la hausse d'une valeur en bourse (Orange)

Construire les briques élémentaires des produits structurés avec des produits dérivés

- Les produits structurés à capital garanti
- Les fonds à formule
- Exercice : jouons la hausse du CAC 40 sur 7 ans en garantissant le capital

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

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

A DISTANCE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

AIX-EN-PROVENCE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

BORDEAUX

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

CHAMBERY

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

GRENOBLE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

LILLE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

LYON

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

MARSEILLE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

MONTPELLIER

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

NANTES

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

NICE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

NIORT

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

PAU

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

RENNES

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

ROUEN

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

STRASBOURG

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

TOULOUSE

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026

TOURS

- 5-6 Oct. 2026
- 7-8 Déc. 2026