

## Marché monétaire au quotidien

Déployer l'ensemble des techniques de gestion sur un portefeuille de produits de taux en cash et dérivés

Code  
**516**

Durée  
**2 jours / 14 heures**

Tarif  
**Nous contacter**

*\*Repas inclus (en présentiel)*

### PUBLIC

Gérants - Trésoriers - Risk managers  
- Toute personne souhaitant acquérir des compétences supplémentaires sur ce sujet

### 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 formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail

## Objectifs pédagogiques

- Discerner les différents types de produits de taux, cash et dérivés à court terme
- Identifier les paramètres de risque et de pricing des instruments cash et dérivés
- Appliquer les stratégies mises en place par les opérateurs du marché monétaire

## 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 techniques d'investissement cash

- Les dépôts
- Le change à terme et les swaps cambistes
  - ▶ Les TCN du marché monétaire
  - ▶ Euro CP, NEU CP, etc.
  - ▶ ABCP
- Les pensions
- Les asset-swaps
- Pricing des instruments

### Les dérivés fermes court terme

- Principe, utilisation et pricing des instruments
  - ▶ FRAs
  - ▶ Futures
  - ▶ IRS
  - ▶ Swaps OIS
  - ▶ Autres swaps

### Références et conventions du marché monétaire

- Eonia et Euribor

- 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](mailto: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.

- Courbe des taux court terme
- Calculs et pratiques de marché
- Conventions de taux

### Les fondamentaux de la politique monétaire des banques centrales

- Actions et objectifs
- Mécanismes des interventions

### Comprendre les relations d'arbitrage entre les différents instruments court terme

### Quels sont les adossements possibles entre produits cash et dérivés ?

- TP : calculs de taux de dépôts, swaps de change, FRAs, swaps OIS comptant et à terme, équivalences de taux monétaires

### 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.

