

📌 Réglementations sur les dérivés OTC et impacts middle-office

Appliquer les réglementations EMIR, MiFID 2 et DODD-FRANK de l'exécution jusqu'à la compensation

Code
700164

Durée
1 jour / 7 heures

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

Objectifs pédagogiques

- Décrire les réglementations européennes sur les produits dérivés, EMIR, MiFID 2 et la réglementation US (Dodd-Frank) sur les dérivés OTC
- Compléter tous les champs d'application de ces réglementations sur les processus Middle Office
- Formaliser les champs dans les systèmes : identifiants LEI, UTI, ISIN, affirmation et confirmation, réconciliation des positions, trade reporting, collatéralisation et clearing

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.

Introduction

- Les engagements du G-20
- Les objectifs du G20 sur la Stabilité Financière
- Atténuation des risques et transparence
- La réponse réglementaire mondiale : juridictions, régulateurs, réglementations et engagements

La structure politique EMIR et les mécanismes de décision

- Structure politique
- Mécanismes de décision

La réglementation EMIR

- Timeline
- Eligibilité
- Les principaux requirements
- Les exemptions

Les techniques d'atténuation des risques

- Timely confirmation
- Valorisation

PUBLIC

Managers et collaborateurs de Middle et Back Office – Responsables conformité – Juristes – Toute personne ayant déjà des notions maîtrisées sur le sujet et souhaitant se perfectionner

PRÉ-REQUIS

Avoir de bonnes connaissances et expériences sur le sujet

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 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-daloz.fr

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

- Réconciliation des portefeuilles
- Compression des portefeuilles
- Résolution des différends

Reporting au trade repository

- Regulatory requirements
- Schéma des flux
- Trade repositories
- Le plan d'action de l'ESMA

Les développements récents

- EMIR REFIT
- EMIR 2.2
- Le contexte du Brexit
- Cas des opérations de change liées à des titres FX Spot / FX Forward
- Clearing : définition, modèles, principe et mécanisme

Les impacts EMIR sur le middle office

- Les identifiants réglementaires et leur utilisation : LEI, UTI, UPI
- Les processus opérationnels et les points d'attention
- L'exécution
- Le matching
- Le clearing
- Le reporting
- La réconciliation
- La valorisation
- Le collateral management

La réglementation MiFID2 / MiFIR

- Les obligations MiFID2 / MiFIR
- Le périmètre d'éligibilité
- L'obligation de négociation
- La transparence
- La protection des investisseurs
- Le reporting des transactions
- Les impacts middle office
- Le contexte du BREXIT

La réglementation américaine : Dodd-Frank

- Eligibilité
- Les requirements

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.

