

Mettre en œuvre les outils de gestion du risque de taux

PUBLIC

Trésoriers – Responsables comptables – Responsables administratifs et financiers – Contrôleurs de gestion – Toute personne souhaitant se prémunir contre des risques de taux d'intérêt

PRÉ-REQUIS

Connaissances de base des produits dérivés ou avoir le niveau de la formation :

🔗 [Marchés financiers : les fondamentaux \(593 \)](#)

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

LES POINTS FORTS

Clés pour identifier et utiliser les outils de couverture du risque de taux les plus efficaces

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

Code
702953

Durée
1 jour / 7 heures

Tarif Inter*
1190 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

Objectifs pédagogiques

- Evaluer le risque de taux
- Utiliser les instruments de couverture du risque de taux

Programme de la formation

Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur reçoit vos objectifs de progrès.

Evaluer le risque de taux

- L'identification du risque de taux sur le bilan de l'entreprise
- La maturité et la sensibilité d'un titre
- La duration appliquée à la valeur de l'entreprise
- Cas pratique : identifier les impacts du risque de taux sur les états financiers d'une entreprise

Utiliser les instruments de couverture du risque de taux

- Les contrats fermes de gré à gré : terme contre terme (Forward-Forward), FRA (Forward Rate Agreement), swap de taux
- Les contrats à terme en marché organisé : principes de fonctionnement, les contrats Euribor
- Les instruments conditionnels : les options de taux (Cap, Floor, Collar, Option sur FRA), les options sur contrat à terme
- Le traitement comptable des opérations de couverture de taux
- Cas pratique : gérer le risque de taux d'une entreprise

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.

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.



Prochaines sessions

...

PARIS

- 18 Sep. 2026 – Session Garantie
- 16 Nov. 2026

A DISTANCE

- 18 Sep. 2026 – Session Garantie
- 16 Nov. 2026

