Formation Marchés de capitaux et produits dérivés

Durée : 14 heures

Certification : BTS Banque

Prix : 1650

Référence : 2101464

Catégorie	Comptabilité et Gestion
Sous-catégorie	Banque Finance Assurance
Pour qui ?	Sales et traders juniors, acteurs au sein de middle-office ou des back-office. Comptables, trésoriers et financiers. Consultants métiers et maîtrises d'ouvrage.
Prérequis	Aucune connaissance particulière.
Objectifs pédagogiques	Connaître les principaux acteurs du secteur financier Appréhender le fonctionnement des produits dérivés Comprendre le fonctionnement de produits de taux et obligations Identifier les standards de mesure des risques liés aux marchés de capitaux
Contenu de la formation	Présentation des marchés de capitaux Les principaux acteurs du secteur financier. Les marchés de capitaux dans le secteur financier. Activité du front-office, du middle-office et du back-office. Exercice Compléter un organigramme de l'organisation Front to Back d'un département de trading.

	Vocabulaire financier et classes d'actifs Les taux, les obligations et le change. Les actions et indices, les matières premières et les dérivés de crédit. Marché organisé et négociation de gré à gré. Produits dérivés, sous-jacents et titres. Produits vanilles, exotiques et hybrides. Exercice Traduction en langage courant de situations décrites en salles de marché. Typologies des produits dérivés bancaires Swap. Forward & future. Repo. Options vanilles (call et put) et volatilité. Options barrières et exotiques. Travaux pratiques Identification de produits financiers à partir de leur description. Evaluation de la position résiduelle d'un portefeuille de produits dérivés. Produits de taux et obligations Le marché des taux et marché obligataire. Swap de taux, FRA (forward rate agreement), future de taux. Cap-floor et swaption. La courbe de taux. Obligations, coupons, yield, duration. Future sur obligations. Travaux pratiques Calcul de pay-off de FRA, de cap-floor et swaption. Calcul de yield et de duration d'une obligation. Produits de change et produits actions et indices Le marché des changes et le marché action et indices. Spot, forward, NDF (Non Deliverable Forward), swap de change. Option de change, option quanto. Achat et vente d'action, dividendes, future et forward.

	Option sur actions et indices (quanto et composite), warrant. Travaux pratiques Calcul de pay-off de forward, NDF et d'options. Mesure d'impact d'une tombée de dividende sur le prix d'une action. P&L, market value et risque de marché Market value (principe de calcul). P&L (Product & Loss) : notion et composants. Risque de marché, de crédit et opérationnel. Les sensibilités (delta, gamma, vega, theta, rho). La Value at Risk. Les stress tests. Travaux pratiques Identifier les paramètres déterminant le P&L d'un portfolio. Calcul de P&L. Calcul de market value de produits simples. Calcul de delta, de gamma et de vega.
Suite de parcours possible	Ingénieur risque Conseiller financier / Gestionnaire de patrimoine Trader - Front office
Éligible au CPF	

FINANCEMENTS

OPCO
OPCA
FAF
Pôle Emploi
La Région

MON COMPTE FORMATION

CONTACTS

IFFP - Tour Belvédère SPACES
1 Cours Valmy 92 800 Puteaux

01 80 88 44 55

administration@iffp.pro