



PERSPECTIVES

SUCCESS NEEDS PERSPECTIVES

Formation :	Utiliser les produits dérivés en gestion - Moteur de performance et Instruments de couverture
Domaine de la formation :	Banques - Assurances
Type de la formation :	Formation courte
Durée :	3 jours (18heures)
Lieu :	Hôtel 5* à Gammarth
Prix :	880 DT HT - 985 DT TTC
Introduction :	Cette formation est proposée en partenariat avec Bärchen organisme européen de formation spécialisé en formation financière pour banques, sociétés de gestion, opérateurs de marché, assurances et mutuelles.
Conseillée aux :	Banques, Organismes Financiers, Organismes d'Etat, Collaborateurs de places de Marchés, Directions financières, Analystes financiers
Profil formateur :	Expert maîtrisant avec précision le mécanisme, l'utilisation et le pricing des dérivés. Conçoit et anime des formations de présentation en public et sur les problématiques de communication et de management.
Objectifs :	<ul style="list-style-type: none">• Maîtriser les méthodes de couverture de portefeuille par les produits dérivés• Utiliser les dérivés pour améliorer ses performances en gestion des risques• Comprendre le fonctionnement des structurés



Contenu :	Prix et risques des dérivés <ul style="list-style-type: none">• Dérivés fermes : Futures et Swaps• Dérivés optionnels : actions et taux• Dérivés de crédit• Sensibilité, grecques et gestion du risque TP Excel : analyse du prix et des sensibilités de dérivés simples
	Les dérivés comme moteur de performance <ul style="list-style-type: none">• Intérêts, risques et limites des produits dérivés en gestion• Principales stratégies optionnelles• Utiliser des exotiques en gestion : binaires, à barrière, sur moyenne, etc.
	Instruments hybrides <ul style="list-style-type: none">• Warrants• Obligations convertibles• Obligations callable• Option adjusted spread• CFD• Swap de performance• ETF• Swaps de variance : la volatilité comme actif, contrats sur indices VIX TP : stratégie de gestion et choix des instruments
	Assurance portefeuille <ul style="list-style-type: none">• La méthode du Stop Loss• Couverture par Futures TP : mise en place et ajustements dans le temps d'une couverture par Futures <ul style="list-style-type: none">• Les méthodes optionnelles OBPI• La méthode du cousin CPPI TP : extension des méthodes aux marchés actions et crédit
	Produits structurés <ul style="list-style-type: none">• Création d'un produit structuré• Les principaux structurés<ul style="list-style-type: none">- Produits mono sous-jacents à base d'options vanille ou exotiques- Produits sur fonds, les fonds à cousin type CPPI• Exemple des structurés sur fonds TP : études de produits structurés dans le marché
	Risque et reporting de gestion <ul style="list-style-type: none">• Reporting et ratio réglementaire• Indicateurs de performance et de risque• Traitement des options
	Prix et risques des dérivés <ul style="list-style-type: none">• Dérivés fermes : Futures et Swaps• Dérivés optionnels : actions et taux• Dérivés de crédit• Sensibilité, grecques et gestion du risque TP Excel : analyse du prix et des sensibilités de dérivés simples
	Les dérivés comme moteur de performance <ul style="list-style-type: none">• Intérêts, risques et limites des produits dérivés en gestion• Principales stratégies optionnelles• Utiliser des exotiques en gestion : binaires, à barrière, sur moyenne, etc.
	Instruments hybrides <ul style="list-style-type: none">• Warrants• Obligations convertibles• Obligations callable• Option adjusted spread• CFD• Swap de performance• ETF• Swaps de variance : la volatilité comme actif, contrats sur indices VIX TP : stratégie de gestion et choix des instruments
	Assurance portefeuille <ul style="list-style-type: none">• La méthode du Stop Loss• Couverture par Futures TP : mise en place et ajustements dans le temps d'une couverture par Futures <ul style="list-style-type: none">• Les méthodes optionnelles OBPI• La méthode du cousin CPPI TP : extension des méthodes aux marchés actions et crédit
	Produits structurés <ul style="list-style-type: none">• Création d'un produit structuré• Les principaux structurés<ul style="list-style-type: none">- Produits mono sous-jacents à base d'options vanille ou exotiques- Produits sur fonds, les fonds à cousin type CPPI• Exemple des structurés sur fonds TP : études de produits structurés dans le marché
	Risque et reporting de gestion <ul style="list-style-type: none">• Reporting et ratio réglementaire• Indicateurs de performance et de risque• Traitement des options



Méthodes pédagogiques : Une pédagogie active, avec la mise en situation à partir de simulations sous Excel.