Les produits dérivés pour analystes: accent sur les modèles et la gestion des risques

OBJECTIFS

Cette formation comprend un E-learning et un webinaire en direct. Vous devez suivre l'E-learning avant de participer au webinaire en direct.

En tant qu'analyste ou risk manager, vous avez besoin de connaissances sur les modèles, les produits et les risques correspondants ? Cette formation offre une connaissance approfondie des modèles de valorisation et de gestion des risques. Nous aborderons tous les aspects des prix forward et futures, des concepts de non-arbitrage et de risque neutre, des simulations de Black Scholes Merton, Gserie et Monte Carlo, des options exotiques et des dérivés de taux. Une attention particulière est accordée à la valorisation, aux risques et aux applications concrètes de ces instruments.

RESUME

Catégorie:

- Risk, finance & treasury

Niveau:

Expert

Type de formation:

Webinaire en direct

Prix:

Les directives de tarification conjointe sont appliquées dans le cadre d'une initiative conjointe.

Heures de recyclage:

- Banque: **7h** spécifique au secteur

PUBLIC

La formation peut être suivie par différents groupes cibles, à savoir les membres de la direction, les cadres et les employés :

- qui remplissent une fonction de risk manager, d'analyste, d'analyste quantitatif ou de gestionnaire de produit ;
- qui sont responsables de la gestion de portefeuille ;
- des pouvoirs publics et des organismes de contrôle ;
- qui remplissent une fonction de compliance ;
- qui remplissent une fonction dans la salle des marchés ;
- qui sont membres du Conseil d'administration, qui font partie de la direction des organes opérationnels ou qui sont collaborateurs d'un organisme de financement des pensions (OFP) ;
- de départements comptables, juridiques, fiscaux, opérationnels et administratifs.

CONNAISSANCE PRÉ-REQUIS

Formation de niveau expert : cette formation requiert une connaissance préalable approfondie du sujet.

Préparation : Suivez l'E learning avant de participer au webinaire en direct. Le moment interactif est prévu pour soutenir les connaissances acquises dans l'E-learning.

PROGRAMME

CONTENU

Cette formation comprend un E-learning et un webinaire en direct. **Vous devez suivre l'E-learning avant de participer au webinaire en direct.** Pensez-vous avoir déjà les connaissances de base nécessaires ? Testez vos connaissances à l'aide du test préliminaire qui se trouve sur la première page de l'E-learning.

La webinaire direct est centrée sur des exemples pratiques et des exercices. Les concepts mathématiques sont clairement expliqués en mettant l'accent sur la compréhension. Une documentation supplémentaire est prévue pour des explications plus détaillées. Nous examinons ensemble les caractéristiques de certains produits dérivés, leur niveau de risque et leur potentiel d'intérêt pour le client.

E-learning *(durée 1 heure)*

- Test préliminaire
- Non-arbitrage
- Calcul des prix forward
- Distinction entre le prix forward et la valeur d'un forward
- Le risque de base

Webinaire en direct *(durée 6 heure)*

- Pop quiz : Qu'avez-vous retenu de l'E-learning ?
- Black Scholes Merton et Monte Carlo
  - Processus stochastisque
  - Équation différentielle partielle de Black Scholes Merton
  - Valorisation des options européennes avec le modèle BSM
  - Calcul du prix d'une option avec simulation Monte Carlo
- Options exotiques
  - Classement des principaux types d'options exotiques
  - Options exotiques versus options vanilles
  - Distinction entre les options de démarrage anticipé, de cliquet, de choix, barrières, de rétrospection, asiatiques, d'échange et binaires
  - Interdiction de commercialisation d'options binaires en Belgique
- Produits dérivés des intérêts
  - Valorisation des options sur obligations
  - Valorisation des options sur les taux d'intérêt et sur les swaps de taux d'intérêt
  - Dérivés de taux d'intérêt en couverture
  - Identification des dérivés de taux synthétiques

INFORMATIONS PRATIQUES

- **Durée :** E-learning (1 heure) et 1 journée de formation (6 heures de formation)
- **Heures :** 09:00 à 17:00
- **Lieu :** Cette formation sera donnée en ligne.
- **Infos supplémentaires :** Comment bien démarrer votre webinaire? Vous recevez un login et un mot de passe préalablement par e-mail afin d'obtenir votre accès à notre plateforme. Dans la plateforme vous trouverez un lien, en cliquant dessus à la date prévue le webinaire se démarre via Webex. Pour obtenir des heures de recyclage, il est important de vous connecter sous votre propre nom, de suivre la totalité de la journée de formation et de répondre aux questions proposées par le formateur. Veuillez ne pas suivre cette formation à plusieurs participants sur un même PC.

- **Préparation :** Suivez l'E learning avant de participer au webinaire en direct. Le moment interactif est prévu pour soutenir les connaissances acquises dans l'E-learning.
  Pensez-vous avoir déjà les connaissances de base nécessaires ? Testez vos connaissances à l'aide du test préliminaire qui se trouve sur la première page de l'E-learning.

MÉTHODOLOGIE

Un **« Webinaire en direct »** se suit en groupe. C'est « learning-apart-together ». À un moment convenu, le professeur et les participants se connectent à un outil de vidéoconférence, chacun à l'endroit où il se trouve et avec son propre ordinateur. Grâce à la caméra, au microphone et à la fonction chat de cet outil, il existe des possibilités d'interaction et de feed-back, tant des participants à l'enseignant qu'inversement. Le matériel didactique se compose comme base d'une présentation via la plateforme d'apprentissage MyFA, complétée de supports divers tels que syllabus numérique, présentation, extraits audiovisuels…

Type de formation : Hybride

Lors de nos **formations hybrides**, nous combinons l'auto-apprentissage (E-learning) avec un élément interactif (formation en classe ou webinaire en direct). Dans la session interactive, l'accent est mis sur la mise en pratique de la matière et sur le travail avec des cas pratiques.

Matériel pédagogique :

- E-learning ;
- Diapositives principales ;
- Présentation multimédia (diapositives, notes, vidéo, Internet).

La formation porte sur les connaissances techniques relatives aux produits financiers des services bancaires et d'investissement conformément à l'art. 7, § 1er,1°, b et c de l'A.R. du 1er juillet 2006.