BANQUE - ASSURANCE

Dérivés OTC : appliquer la réglementation, sécuriser et fiabiliser le suivi

Sur les dérivés de gré à gré l'écart entre le texte et la salle est vite creusé. Une opération mal catégorisée n'est pas orientée vers la compensation. Un identifiant erroné fait rejeter la déclaration au référentiel. Un appel de marge contesté reste ouvert plusieurs jours. Le middle-office absorbe ces frictions sans disposer toujours d'une lecture claire de l'obligation qui les produit. Cette journée relie chaque obligation réglementaire aux traitements concrets qu'elle impose. Les participants travaillent la catégorisation des contreparties la chaîne de compensation le contenu des déclarations et les échanges de marges. Le niveau suppose une pratique confirmée des dérivés.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
1 jour — 7 h	**Présentiel ou à distance**	**À partir de 1 120 € HT**	**11 jours ouvrés après validation du financement.**

Mon Pôle Formation est un organisme certifié Qualiopi. La certification qualité a été délivrée au titre de la catégorie d'action suivante : **ACTIONS DE FORMATION** — certificat n° 76 31 02622 31 (SGS ICS)

01 Public visé et prérequis

PUBLIC VISÉ
Responsables et collaborateurs de middle-office ainsi que professionnels du contrôle des risques de la conformité et des opérations de marché.

PRÉREQUIS
Pratique confirmée des produits dérivés et des circuits de traitement post-négociation.

POSITIONNEMENT À L'ENTRÉE
Analyse du besoin et test de positionnement. Vos réponses sont partagées avec votre formateur afin d'adapter la formation à votre niveau et votre contexte professionnel.

02 Objectifs pédagogiques

À l'issue de la formation, le participant sera capable de :

- Catégoriser les contreparties et déterminer les obligations applicables à chacune
- Orienter les opérations entre compensation centrale et traitement bilatéral
- Organiser la production des déclarations aux référentiels et le traitement des rejets
- Appliquer les règles d'échange de marges initiales et de variation
- Conduire le rapprochement de portefeuilles et la résolution des différends
- Structurer les contrôles de second niveau sur la chaîne de traitement

03 Programme détaillé

M1 Champ d'application et catégorisation

- Déterminer ce qui s'applique à qui
- Typologie des contrats dérivés de gré à gré concernés
- Catégories de contreparties et seuils déclenchant les obligations
- Exemptions et traitement des opérations intragroupe
- Conséquences opérationnelles d'un changement de catégorie
- Documentation contractuelle et conventions cadres
- Cas pratique : Les participants catégorisent un ensemble de contreparties et en déduisent les obligations applicables.

M2 Compensation déclaration et référentiels

- Sécuriser les flux vers l'extérieur
- Circuit de compensation centrale et rôle des membres compensateurs
- Traitement des opérations restant bilatérales
- Contenu des déclarations et identifiants utilisés
- Gestion des rejets et des écarts de rapprochement entre contreparties
- Suivi de la qualité des données déclarées
- Atelier : Chaque participant analyse une série de rejets de déclaration et identifie la donnée en cause.

M3 Marges rapprochement et contrôles

- Tenir la chaîne au quotidien
- Règles d'échange de marges initiales et de marges de variation
- Valorisation des positions et sources de prix retenues
- Gestion des sûretés reçues et données et suivi des seuils
- Rapprochement de portefeuilles et procédure de résolution des différends
- Construction du dispositif de contrôle et des indicateurs de suivi
- Mise en situation : Le groupe traite un appel de marge contesté depuis l'écart de valorisation jusqu'à la clôture du différend.

04 Modalités pédagogiques, méthodes et moyens

MODALITÉS PÉDAGOGIQUES
Présentiel ou à distance

LIEU / FORMAT
Dans vos locaux — jusqu'à 10 collaborateurs, Paris — Présentiel, À distance — Classe virtuelle

MÉTHODES MOBILISÉES
• Apports théoriques, ateliers et cas pratiques. Support de cours numérique et fiches méthodes fournis.

ENCADREMENT
Formateurs qualifiés et expérimentés, experts de leur domaine, sélectionnés par Mon Pôle Formation.

05 Modalités d'évaluation et de suivi

ÉVALUATION DES ACQUIS
• QCM et mises en situation. Évaluation des acquis en début et en fin de parcours, évaluation à chaud et à froid à 60 jours.

SUIVI DE L'EXÉCUTION
• Émargement des participants
• Certificat de réalisation remis à l'issue de la formation

SANCTION DE LA FORMATION
Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

06 Type de reconnaissance

Formation non certifiante — Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

07 Modalités d'accès, financement et tarifs

MODALITÉS D'INSCRIPTION
Inscription en ligne, par téléphone, par devis ou via votre OPCO.

DÉLAI D'ACCÈS
11 jours ouvrés après validation du financement.

FINANCEMENTS POSSIBLES
- OPCO et plan de développement des compétences
- FAF et CFP
- France Travail
- Paiement jusqu'à 6 fois sans frais

DATES / SESSIONS
Entrées permanentes

FORMULE	DÉTAIL	TARIF
Inter-entreprises	-10 % dès 2 participants, -15 % dès 3, -20 % à partir de 4 inscrits sur la même session.	**À partir de 1 120 € HT**

Prix nets — exonération de TVA, article 261-4-4° du CGI.

08 Accessibilité aux personnes en situation de handicap

Accessible aux personnes en situation de handicap. Contactez notre référent handicap pour construire une solution adaptée : contact@monpoleformation.fr

RÉFÉRENT HANDICAP
Tiffany LESTROUBAC

CONTACT
contact@monpoleformation.fr

09 Indicateurs de résultats

INDICATEUR	RÉSULTAT	MODALITÉS DE CALCUL
Taux de satisfaction	**N/A**	Moyenne des notes de satisfaction des stagiaires sur les 12 derniers mois
Taux d'abandon	**N/A**	Calculé sur les 12 derniers mois

Résultats arrêtés au 29/09/2026. N/A : donnée non disponible ou effectif insuffisant sur la période.

10 Contacts

INSCRIPTIONS ET INFORMATIONS
contact@monpoleformation.fr
01 87 66 57 66

ADRESSE
10a rue du Maréchal de Lattre de Tassigny, 76420 Bihorel

RÉCLAMATIONS
Par e-mail : contact@monpoleformation.fr