BANQUE - ASSURANCE

Produits dérivés : identifier les instruments, comprendre les usages et les risques

Les dérivés reviennent dans les échanges quotidiens sans que chacun partage le même vocabulaire. Un contrat à terme et une option ne répondent pas au même besoin. Les équipes support traitent des opérations dont elles ne saisissent pas la logique économique et les anomalies se détectent tard. Ces deux jours donnent les repères fondamentaux sur les instruments pris isolément. Vous distinguez les familles de dérivés et les marchés sur lesquels ils se traitent. Vous suivez un contrat de son initiation à son dénouement. Vous reliez chaque instrument à un besoin de couverture ou de position. Vous identifiez enfin les principaux risques portés par ces opérations.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
2 jours — 14 h	**Présentiel ou à distance**	**À partir de 1 715 € 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
Collaborateurs des fonctions support middle office back office contrôle et audit ainsi que toute personne abordant les marchés dérivés.

PRÉREQUIS
Aucun prérequis

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 :

- Distinguer les familles d'instruments dérivés et leurs marchés de négociation
- Décrire le mécanisme d'un contrat à terme de son initiation à son dénouement
- Expliquer le fonctionnement d'une option et le rôle de la prime
- Relier un instrument dérivé au besoin économique qu'il sert
- Identifier les principaux risques attachés à une position sur dérivés

03 Programme détaillé

M1 Le paysage des dérivés

- Instruments marchés et acteurs
- Sous-jacents et familles d'instruments
- Marchés organisés et marchés de gré à gré
- Acteurs et motivations de couverture ou de position
- Vocabulaire de référence et notion de nominal
- À retenir : Un dérivé tire sa valeur d'un sous-jacent donc son analyse commence toujours par le comportement de ce sous-jacent.

M2 Contrats à terme et swaps

- Des engagements fermes
- Mécanisme du contrat à terme
- Appels de marge et chambre de compensation
- Principe du swap et échange de flux
- Usages de couverture les plus courants
- Cas pratique : Les participants suivent la vie d'un contrat à terme depuis la prise de position jusqu'à la liquidation.

M3 Les options

- Un droit et non une obligation
- Achat et vente d'options d'achat et de vente
- Composantes de la prime
- Profils de gain à l'échéance
- Stratégies simples de couverture
- Atelier : Chaque binôme trace le profil de gain de positions optionnelles et identifie le risque porté.

M4 Cycle de vie et risques

- Ce qui se passe après la négociation
- Confirmation et traitement de l'opération
- Valorisation et appels de collatéral
- Risques de marché de contrepartie et de liquidité
- Points de contrôle des fonctions support
- Mise en situation : Un participant tient le rôle du middle office et détecte l'anomalie d'une confirmation d'opération.

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 1 715 € 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