

## Comprendre les marchés financiers

Date et durée
Code formation : FMB13FR Durée : 2 jours Nombre d'heures : 14 heures
Description
Le domaine de la finance est complexe et il est nécessaire de maîtriser toutes les bases du fonctionnement des marchés financiers
Objectifs
Cette formation a pour objectif de: <ul style="list-style-type: none"><li>• Assimiler le rôle des marchés financiers dans l'économie et la gestion d'actifs</li><li>• Déchiffrer le prix et les risques associés des principaux instruments financiers</li><li>• Discerner le rôle et l'organisation des différents intervenants</li></ul>
Pré-requis
Il est nécessaire de maîtriser quelques connaissances de base et le vocabulaire du marché financier (les codes, les règles, etc.)
Public
Aux directeurs financiers, aux responsables d'agence bancaire, aux assureurs
Cette formation s'adresse aux profils suivants
<u>Agent général d'assurance</u> <u>Auditeur interne / externe</u> <u>Comptable</u> <u>Contrôleur de gestion</u> <u>Contrôleurs Support Technique</u> <u>Directeur financier</u>
Programme
<b>1 - A quoi servent les marchés ?</b> A- Les acteurs des marchés financiers, les motivations et les inter-relations (États, entreprises, particuliers, banques, sociétés de gestion, etc.) <ul style="list-style-type: none"><li>• Les fonctions des marchés financiers</li><li>• Le placement et le financement : le marché primaire</li><li>• Le transfert des risques</li></ul>

## B- Les acteurs

- Les salles de marchés
- Intervention des Sociétés de Gestion
- Les Hedges Funds
- Rôle et actions des banques
- Organismes régulateurs : AMF, ACP et BCE

C-La typologie des marchés cash et dérivés (les actions, les taux, le change, le crédit et les commodités...)

D- Étude de cas :

Analyse des rendements

- Par classe d'actifs
- Par zone géographique
- Par indice de référence

## 2 - Les produits de marché : comment ça marche ?

A- Le cash

- Les actions
- Produits monétaires et obligataires
- Produits de change

B- Dérivés fermes

- FRA et Futures
- CFD
- Swaps de change, de taux et de crédit (CDS)

C- Les options des plus simples au plus complexes

D- Étude de cas :

**Comment un gérant utilise les produits dérivés pour spéculer ou se couvrir?**

- Les produits structurés
- Les briques essentielles
- L'assemblage

E- Étude de cas :

**Comment construire simplement un produit à capital garanti?**

- Les ETF

## 3 - Mesurer le prix et les risques ?

A- Le prix d'un produit financier : paramètres et méthodes de calcul

B- Les risques : de marché, de contrepartie, de crédit et opérationnels, comment les mesurer ?

C- Étude de cas

- Comprendre le risque de taux d'une obligation
- Analyser le risque d'une option