

Banking & Finance : Produits dérivés II & Produits structurés II

Offre de formation ASG

Titre / thème	Produits dérivés II & Produits structures II
Groupe cible	Gestionnaires de patrimoines
Contenu d'apprentissage	<p>Le thème couvre le calcul de la valeur des options et l'interprétation d'indicateurs d'options. En outre, il aborde les différentes stratégies d'options du point de vue du client et les options exotiques.</p> <p>Dans le thème des Produits structurés les quatre catégories fondamentales (produits de protection du capital, produits d'optimisation de la performance, produits de participation et produits à effet de levier) sont présentées, en soulignant leurs différences principales. À l'aide d'exemples concrets, ce thème explique en détail les types de produits spécifiques de ces quatre catégories.</p>
Lieu de formation	Plateforme de formation en ligne Fintelligence : https://fintelligence.fintelligence-net.com/
Durée d'apprentissage	<p><u>Produits dérivés II</u></p> <ol style="list-style-type: none">1. Indicateurs d'options (90 min)2. Stratégies d'options I (70 min)3. Stratégies d'options II (80 min)4. Options exotiques (60 min)5. Contrôle des connaissances (70 min) <p><u>Produits structures II</u></p> <ol style="list-style-type: none">6. Produits de protection du capital (70 min)7. Produits d'optimisation de la performance (60 min)8. Produits de participation (70 min)9. Produits à effet de levier (70 min)10. Contrôle des connaissances (80 min)
Période	2 mois
Objectifs d'apprentissage	<p><u>Produits dérivés II</u></p> <p><u>Indicateurs d'options</u></p> <p>Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :</p>

- expliquer les différences entre les indicateurs d'options statiques et dynamiques,
- nommer les principaux indicateurs d'options statiques et expliquer leur importance,
- présenter l'importance des indicateurs dynamiques lors de l'évaluation d'options,
- évaluer les options à l'aide de différents indicateurs dynamiques,
- expliquer les indicateurs dynamiques les plus utilisés en utilisant des exemples.

Stratégie d'options I

Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :

- pourrez employer les quatre opérations sur options fondamentales (achat et vente de calls ou puts) conformément aux souhaits du client,
- connaîtrez les différents motifs d'investisseurs pour des transactions sur options et pouvez les exposer à vos clients,
- pourrez classer les stratégies d'options conformément à l'évolution des prix et de la volatilité de la valeur sous-jacente,
- pourrez expliquer des stratégies de couverture importantes, comme le protective put et le long call hedge,
- comprendrez les stratégies courantes d'optimisation de la performance, en particulier la vente couverte ou non couverte d'options d'achat, ainsi que la vente à découvert d'options de vente.

Stratégie d'options II

Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :

- pourrez employer les quatre opérations sur options fondamentales (achat ou vente de calls ou puts) conformément aux souhaits du client,
- connaîtrez les différents motifs d'investisseurs pour des transactions sur options et pouvez les exposer à vos clients,
- pourrez classer les stratégies d'options conformément à l'évolution des prix et de la volatilité de la valeur sous-jacente,
- pourrez expliquer la manière dont les stratégies d'augmentation de rendement courantes sont utilisées et expliquer leurs caractéristiques risque/rendement,
- connaîtrez le concept d'effet de levier dans le contexte des options,
- comprendrez le recours à des options dans l'optique de la diversification de portefeuille.

Options exotiques

Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :

- pourrez expliquer les caractéristiques principales des options exotiques les plus courantes,
- pourrez expliquer les caractéristiques de risque/rendement des options exotiques,
- pourrez comprendre les possibilités d'utilisation des options exotiques et pouvez les exposer à un client.

Produits structures II

Produits de protection du capital

Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :

- connaîtrez les quatre types de produits de protection du capital conformément au map Dérivé de l'Association Suisse des Produits Structurés (ASPS) et pouvez les distinguer l'un de l'autre,
- connaîtrez les principales caractéristiques de construction et le fonctionnement des produits de protection du capital ainsi que les attentes de l'investisseur relatives au marché,
- connaîtrez les opportunités et risques des produits de protection du capital,
- pourrez en particulier expliquer en détail les produits de protection du capital avec participation ou avec coupon.

Produits d'optimisation de la performance

Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :

- connaîtrez les cinq types de produits d'optimisation de la performance conformément à la Swiss Derivative Map de l'Association Suisse Produits Structurés (ASPS) et pouvez les distinguer l'un de l'autre,
- connaîtrez les principales caractéristiques de construction et le fonctionnement des produits d'optimisation de la performance ainsi que les attentes de l'investisseur relatives au marché,
- connaîtrez les opportunités et risques des produits d'optimisation de la performance,
- connaîtrez en particulier le Reverse Convertible et le Barrier Reverse Convertible.

	<p><u>Produits de participation</u></p> <p>Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :</p> <ul style="list-style-type: none"> • connaîtrez les cinq types de produits de participation conformément à la Swiss Derivative Map de l'Association Suisse Produits Structurés (ASPS) et pouvez les distinguer l'un de l'autre, • connaîtrez les principales caractéristiques de construction et le fonctionnement des produits de participation ainsi que les attentes de l'investisseur relatives au marché, • connaîtrez les opportunités et risques des produits de participation, • pourrez en particulier expliquer en détail les certificats Tracker et les certificats Bonus. <p><u>Produits à effet de levier</u></p> <p>Une fois que vous aurez parcouru ce module, vous :</p> <ul style="list-style-type: none"> • connaîtrez les cinq types de produits à effet de levier conformément à la Swiss Derivative Map de l'Association Suisse Produits Structurés (ASPS) et pouvez les distinguer les uns des autres, • pourrez expliquer les fonctionnements des produits à effet de levier, • connaîtrez les principales caractéristiques et le fonctionnement des produits à effet de levier, ainsi que les attentes des investisseurs quant aux marchés, • connaîtrez les opportunités et risques des produits à effet de levier, • connaîtrez, notamment, les warrants et les warrants avec option knock out.
<p>Méthodologie</p>	<p>Étude des modules d'apprentissage en ligne interactifs avec des contenus et des vidéos à découvrir et contrôle de l'apprentissage en ligne.</p>
<p>Contrôle des connaissances</p>	<p>Les deux tests ses composent de 15 à 20 questions à choix multiple. Vous réussissez les tests si vous obtenez au moins 70% du nombre maximal de points.</p>