

Banking & Finance: Produits dérivés I & Produits structures I

Offre de formation ASG

Titre / thème	Produits dérivés I & Produits structures I
Groupe cible	Gestionnaires de patrimoines
Contenu d'apprentissage	<p>Le thème Produits financiers dérivés présente les principaux types et propriétés des produits financiers dérivés, ainsi que les différentes opérations à terme. Vous découvrirez également les opérations sur options fondamentales et les facteurs qui influencent la valeur des options.</p> <p>Le thème des Produits structurés décrit la construction, les principales caractéristiques, les attentes des investisseurs, ainsi que les opportunités et risques de cette catégorie d'actifs.</p>
Lieu de formation	Plate-forme de formation en ligne Fintelligence: https://fintelligence.fintelligence-net.com/
Durée d'apprentissage	<p><u>Produits dérivés I</u></p> <ol style="list-style-type: none">1. Bases (70 min)2. Options (70 min)3. Eléments du prix d'option (70 min)4. Valeur de l'option (60 min)5. Contrôle des connaissances (70 min) <p><u>Produits structures I</u></p> <ol style="list-style-type: none">6. Constitution et caractéristiques (80 min)7. Catégories de produits et risques (80 min)8. Contrôle des connaissances (80 min)
Période	2 mois
Objectifs d'apprentissage	<p><u>Produits dérivés I</u></p> <p><u>Bases</u></p> <ul style="list-style-type: none">• Une fois ce module réalisé, vous pouvez expliquer le concept et les propriétés des produits dérivés,• nommer les types de produits dérivés,• distinguer les différentes opérations à terme (options, futures et forwards),• expliquer les valeurs sous-jacentes possibles des dérivés,• montrer les différentes possibilités de négoce des dérivés,• exposer les conditions pour l'achat et la vente de dérivés par les

clients.

Options

- Une fois ce module réalisé, vous pouvez expliquer le déroulement d'une option d'achat et de vente,
- expliquer les différences entre une position longue et une position courte,
- différencier les quatre positions de base que l'acheteur et le vendeur d'une option peuvent ouvrir,
- décider quand une option doit être exercée ou non,
- calculer les profits et pertes,
- montrer les différentes possibilités d'action d'un acheteur ou d'un vendeur pendant la durée d'une option.

Eléments du prix d'option

- Une fois ce module réalisé, vous pouvez expliquer de quels facteurs d'influence dépend la formation du prix des options,
- décider quels facteurs d'influence sont les plus importants pour un call ou un put,
- exposer comment les changements au niveau des facteurs d'influence influent sur le prix d'option.

Valeur de l'option

- L'étude de ce module vous permet d'expliquer ce qu'on entend par la juste valeur ou la valeur théorique d'une option (fair value),
- d'expliquer comment calculer correctement le prix d'option à l'aide de la formule de Black-Scholes,
- de calculer le juste prix d'une option à l'aide d'une feuille de calcul Excel ou d'un calculateur de prix d'option,
- d'expliquer la parité put-call d'une option et de mener une réflexion concernant la formation de valeur d'une option de façon utilisable.

Produits structures I

Constitution et caractéristiques

Une fois que vous avez réalisé ce module

- vous disposerez d'une compréhension fondamentale de l'utilisation des produits structurés dans le cadre du conseil en placement,
- vous pourrez comprendre les produits structurés, les classer et les réévaluer,

	<ul style="list-style-type: none"> • vous pourrez expliquer les caractéristiques de construction et de fonctionnement significatives des produits structures. <p><u>Catégories de produits et risques</u></p> <p>Une fois que vous avez réalisé ce module</p> <ul style="list-style-type: none"> • vous pourrez faire la distinction entre les principaux types de produits structures, • vous connaîtrez la classification des produits structurés, conformément à la catégorisation de l'Association Suisse Produits Structurés (ASPS), • vous pourrez décrire les opportunités et les risques des différents types de produits au cours des entretiens avec les clients.
<p>Méthodologie</p>	<p>Etude 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% de la note maximale.</p>