Les instruments de la dette belge en un coup d'oeil

OBJECTIFS

La présentation aborde les obligations linéaires, les certificats de trésorerie, les Euro Medium Term Notes et l'Euro Commercial Paper. L'évaluation et la couverture de ces instruments sont illustrées par des exemples concrets tirés de la vie réelle. A l'issue du cours, le participant dispose d'une vision claire et cohérente des instruments de la dette belge, de leurs principes d'évaluation et de la gestion de leur risque de taux d'intérêt et de leur risque de change.

RESUME

Catégorie:

- Risk, finance & treasury

Niveau:

Avancé

Type de formation:

Formation en classe

Prix:

- Membre: € 575.00
- Non-membre: € 675.00
- Partner BZB: € 575.00
- Incompany: sur mesure, prix à la demande

Heures de recyclage:

- Banque: **6h** spécifique au secteur

PUBLIC

La formation peut être suivie par différents groupes cibles, parmi lesquels entre autres:

- Direction, cadres et employés responsables de la gestion de portefeuille et/ou du conseil en investissement
- Direction, cadres et employés des départements produits, risk, compliance, comptable, juridique, fiscal, opérationnel et administratif
- Membres du Conseil d'Administration, direction des organes opérationnels et collaborateurs d'un Organisme pour le Financement des Pensions
- Direction, cadres et employés des organes monétaires ou de contrôle?

CONNAISSANCE PRÉ-REQUIS

Advanced: mise en pratique des connaissances théoriques déjà acquises lors des formations 'basic level' (approfondissement).

PROGRAMME

Contenu

Introduction

- Marché monétaire, marché des changes, marché des capitaux
- Taux d'intérêt fixe, taux d'intérêt variable
- Forward, option, instrument classique, instrument structuré

Instruments de la dette

- Obligation linéaire (définition, caractéristiques, chiffres)
- Certificat de trésorerie (définition, caractéristiques, chiffres)
- Euro Medium Term Note (définition, caractéristiques, EMTN Program, chiffres)
- Euro Commercial Paper (définition, caractéristiques, chiffres)

Principes d'évaluation

- Taux d'intérêt (Yield Curve, différents taux d'intérêt, prix, return, rendement actuariel, durée)
- Instruments (Certificat de Trésorerie, courbe des taux d'intérêt spot, dépôt interbancaire, OLO, obligation d'entreprise, FRN, conclusions)
- Interpolation linéaire (estimation du prix et du rendement actuariel, convexité)
- Inflation (obligation indexée sur l'inflation, inflation swap)

Gestion du risque (dérivés)

- Forward Rate Agreement, Interest Rate Swap
- Currency Forward, Cross Currency Swap
- Bond Option (callable bond, putable bond)
- Interest Rate Option (cap, floor)
- Currency Option (call, put)

Conclusions

Aspects pratiques

Durée: 1 journée de formation

Heures: 9h à 17h (6 heures de formation par jour)

Lieu: Febelfin Academy, Bâtiment Phoenix - Boulevard du Roi Albert II 19 1210 Bruxelles

MÉTHODOLOGIE

Une **« Formation en classe »** se suit en groupe. Vous êtes présent avec les autres participants et le professeur à un moment convenu dans la même salle de cours. Il existe des possibilités d'interaction et de feed-back, tant des participants à l'enseignant qu'inversement. Le matériel didactique se compose comme base d'une présentation via la plateforme d'apprentissage MyFA, complétée de supports divers tels que syllabus numérique, présentation, extraits audiovisuels…

Forme: En présentiel

Durant nos **formations théoriques,** nous proposons une combinaison de théorie et d'exercices. Les cas, exemples et exercices sont tirés de la pratique quotidienne ou sont présentés par vos soins et ensuite résolus avec l'aide du formateur.

Matériel didactique:

- Dias, notes, vidéo et internet

- Présentation Keynote (print out)

Banque: Les connaissances **techniques relatives aux produits financiers** et aux services bancaires et d'investissement, conformément à l'article 7, §1er, 1°, b et c. de l'AR du **1er juillet 2006**.