

Gestion des risques de change et taux

CATEGORIE : C

Vue d'ensemble

Domaine(s) d'activité professionnel dans lequel(s) est utilisé la certification :

Transverse : ■ **Trésorerie d'entreprise**

Ce certificat s'adresse aux collaborateurs des services financiers (toute taille d'entreprise, et secteur d'activité confondus) souhaitant valider leurs acquis ou envisager une évolution professionnelle ainsi qu'à des consultants ou banquiers ayant besoin de comprendre l'activité de leurs clients internes ou externes.

Code(s) NAF : —

Code(s) NSF : **314**, **313**

Code(s) ROME : **M1207**, **M1206**, **M1205**, **M1201**

Formacode : **32611**

Date de création de la certification : **28/06/2013**

Mots clés : **couverture des risques de trésorerie**,
gestion des risques de taux,
gestion des risques de change, **trésorier**

Identification

Identifiant : **2533**

Version du : **08/04/2017**

Références

Consensus, reconnaissance ou recommandation :

Formalisé :

- [La crise financière de 2008 a remis le trésorier au centre de l'entreprise. Il est amené à devenir de plus en plus polyvalent](#)
- [La trésorerie d'entreprise : un sujet stratégique pour les entreprises](#)

Non formalisé :

- [La crise a mis en lumière le rôle vital du trésorier dans la gestion des flux et des risques financiers](#)
- [Les trésoriers se voient de plus en plus endosser la casquette de risk manager pour gérer les aléas](#)

Descriptif

Objectifs de l'habilitation/certification

Certifier les compétences professionnelles nécessaires à la mise en place et au suivi d'une gestion des risques de change et taux dans le cadre de la fonction trésorerie.

Lien avec les certifications professionnelles ou les CQP enregistrés au RNCP

- Aucun

Descriptif général des compétences constituant la certification

La certification est constituée des 3 axes de compétence suivants :

- Gérer le risque de change
- Gérer le risque de taux
- Mettre en place des outils de couverture des risques de change et de taux

Public visé par la certification

Tous publics

Modalités générales

Objectifs de la formation : Objectifs de la formation : L'acquisition des connaissances et des pratiques professionnelles concernant :

- Les mécanismes de génération des expositions aux risques de change et de taux
- Les stratégies et techniques de gestion de ces risques
- La négociation des instruments de couverture
- Les systèmes d'information associés

Durée de la formation : 5 Jours, soit 35h, en présentiel en discontinu

Intitulé et durée des modules de formation :

- Traiter sur les marchés financiers (1J)
- Les outils de gestion du risque de change (2J)
- Les outils de gestion du risque de taux (2J)

Modalités pédagogiques :

- Approche opérationnelle et concrète des connaissances et compétences professionnelles.
- Formation en présentiel délivrée par des trésoriers professionnels.
- Mise en pratique par la réalisation de nombreux exercices et études de cas.

Liens avec le développement durable

Aucun

Valeur ajoutée pour la mobilité professionnelle et l'emploi

Pour l'individu

- Bénéficier de la reconnaissance de la certification par les professionnels de la trésorerie d'entreprise, en France et en Europe, et bénéficier du réseau et de la légitimité du certificateur (AFTE).
- Consolider les compétences nécessaires à l'évaluation du risque, au choix des outils et à la mise en place des actions de couverture des risques.
- Valoriser son parcours professionnel et élargir son champ d'expertise à la mise en application de la politique de gestion du risque de change et de taux.
- Renforcer son expertise professionnelle afin, notamment, d'agir sereinement et efficacement dans un environnement complexe et évolutif.

Pour l'entité utilisatrice

Faire bénéficier ses collaborateurs de formations délivrées par des experts métiers apportant des réponses concrètes dans un contexte évolutif. Bénéficier de l'ancrage professionnel et de la légitimité du certificateur (AFTE), en France et en Europe.

Renforcer l'expertise des professionnels de la fonction trésorerie, sur l'évaluation du risque de change et de taux, sur le choix des outils et la mise en place des actions de couverture de ces risques. Se doter de compétences en interne pour améliorer la mise en œuvre de la politique de gestion des risques de change et de taux.

Garantir les bonnes pratiques de trésorerie au sein de l'organisation.

Evaluation / certification

Pré-requis

Avoir validé le certificat Gestion quotidienne et prévisionnelle de l'AFTE.
Avoir suivi l'intégralité de la formation (5J) ou justifier d'une formation ou d'une expérience professionnelle équivalente.

Compétences évaluées

Centre(s) de passage/certification

- Locaux de l'AFTE

C1. Évaluer l'exposition au risque de change en identifiant les différentes sources du risque

C2. Arbitrer le choix des outils de couverture du risque de change en fonction des objectifs de couverture définis

C3. Mettre en place un suivi des outils de couverture du risque de change qui respecte les contraintes réglementaires

C4. Évaluer l'exposition au risque de taux en identifiant les différentes sources du risque

C5. Arbitrer le choix des outils de couverture du risque de taux en fonction des objectifs de couverture définis

C6. Mettre en place un suivi des outils de couverture du risque de taux qui respecte les contraintes réglementaires

C7. Négocier auprès des banques afin de sélectionner la meilleure offre pour chaque outil de couverture choisi

Niveaux délivrés le cas échéant (hors nomenclature des niveaux de formation de 1969)

Absence de niveaux

La validité est Permanente

Possibilité de certification partielle : non

Matérialisation officielle de la certification :

Certificat professionnel FFP

Plus d'informations

Statistiques

1200 jours de formation ont été dispensés en 2015, et 100 certificats ont été délivrés sur la période 2012/2015, toutes thématiques confondues.

5 certificats en gestion des risques de change et taux ont été délivrés sur la période 2013/2016.

Autres sources d'information

<http://www.afte.com/>

<http://www.afte.com/commissions.php>

<http://www.afte.com/certificats.php>

<http://www.eact.eu/education/>