

Cartographier les outils, processus et activités du Back Office pour les opérations sur dérivés

Code  
**412**

Durée  
**2 jours / 14 heures**

Tarif  
**Nous contacter**

*\*Repas inclus (en présentiel)*

### **PUBLIC**

Managers et collaborateurs de back-office et middle office banque/assurance/société de gestion – Managers et collaborateurs de la fonction contrôle interne (Banques, Assurances, Sociétés de gestion/Asset Managers, Banques privées, Family office, Courtiers) – Département Risk Management – Fonction IT – Consultants SSII Banque-Assurance – Dépositaires – SGP

### **PRÉ-REQUIS**

Une expérience pratique sur le sujet est recommandée

### **NIVEAU D'EXPERTISE**

Perfectionnement

### **MOYENS PÉDAGOGIQUES**

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

### **SATISFACTION ET EVALUATION**

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
  - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale

## **Objectifs pédagogiques**

- Inventorier l'ensemble des opérations de gestion de flux et de stock
- Faciliter les relations avec le Front Office et la comptabilité
- Repérer les opérations sensibles et identifier les points de vigilance

## **Programme de la formation**

### **Inventorier l'ensemble des opérations de gestion de flux et de stock**

#### Lister les instruments dérivés

- Organisation et acteurs des marchés de dérivés
- Les produits : FRA, Futures, Swaps, Options vanille, exotiques, CDS...
- Quiz

#### Gérer les stocks d'opérations

- Saisie et interface des nouveaux deals
- Opérations internes et externes
- La vie des stocks et son suivi
- Modifications et annulations

#### Utiliser les référentiels

- Cash settlement et physical delivery
- Gestion des Opérations Sur Titres
- Etude de cas : décortiquer un produit exotique

#### Gérer les flux de trésorerie

- Les primes, deposits et appels de marge
- Pay off et frais de courtage
- Exercice : Influence des calendriers de jours ouvrés sur les montants à payer

### **Faciliter les relations avec le Front Office et la comptabilité**

#### Suivre les annonces de trésorerie et de paiement

- Le suivi de la caisse et le refinancement
- Les cut off et deadlines
- Les instructions de paiement
- Swift et la sécurisation des paiements
- Exercice : Les messages SWIFT (101/ 202) banque à banque et messages de paiement

et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

## Procéder aux contrôles et rapprochements

- Rapprochements avec l'extérieur et avec le Front
- Le suivi des Nostris
- Les rapprochements comptables
- Trioptima
  
- Quiz

## Définir une approche de comptabilisation

- Comptabilisation des opérations
- Comptabilisation des flux de trésorerie
- Bilan, compte de résultat et hors bilan
  
- Mise en perspective: le hors bilan chez Enron par Arthur Andersen, Décembre 2001 : là où tout a commencé

## Repérer les opérations sensibles et identifier les points de vigilance

### Sécuriser les aspects juridiques : gestion des contrats de gré-à-gré (OTC)

- Valorisations et PNL
- Flux et stocks de résultats
- Notion de contrat cadre / ISDA – CSA – Master agreement...
  
- Exercice

### Etudier les outils utilisés : évolution vers du Straight Through Processing (STP)

- Influence des systèmes de place
- Vers plus de compensation centralisée des opérations
- La collatéralisation
- Risque opérationnel et points de vigilance
  
- Mise en perspective par plusieurs cas de STP dont le cas Kerviel chez SG

## Parmi nos formateurs



### Tanguy Loreau

Tanguy est responsable de la gestion Back Office de tous les produits dérivés, de trésorerie et de change pour Natixis. Son expérience de plus de 15 ans lui permet de vous faire profiter de son recul et des cas réels dont il a pu témoigner.