

Centre de Formation

PROGRAMME GESTION DES OPÉRATIONS & RISQUES FINANCIERS RNCP37437BC03

Présentation synthétique.

La formation Gestion des opérations & risques financiers (125 heures : 60 heures synchrones et 65 heures asynchrones), certifiante et proposée par Xeilos Trading, valide le bloc 3 de compétences de la certification d'expert en finance de marché, dont le certificateur est l'ESG (RNCP37437BC03). Elle forme les participants à l'identification, la mesure et la gestion des risques financiers associés aux marchés de capitaux. Les objectifs incluent la surveillance, le contrôle et l'évaluation des risques, la conformité aux réglementations, le développement de stratégies de gestion des risques et la proposition de couvertures basées sur des produits dérivés. De plus, cette formation vise à gérer les risques opérationnels et de contrepartie, ainsi qu'à améliorer les processus et stratégies de gestion des risques par l'analyse continue des performances des traders et des opérations de marché.

Ce programme vous donne accès au Bloc 1 du Mastère Expert en Finance de Marché.

Modalités de formation :

Durée et horaires de la formation

Durée de la Formation : 125h

Tarifs : 3990 EUROS

Contacts : CACACE Gregory

TEL : 04.89.05.03.55 MAIL : contact@xeilos.fr

Formation en Présentiel

Délais d'accès : Les délais sont de 14 jours à partir de la validation de l'inscription.

Accessibilité aux personnes en situation de handicap : Formation accessible aux personnes en situation de handicap. Contact : Gregory CACACE.

Toutes les dispositions nécessaires pour accueillir les personnes en situation de handicap seront prises, conformément aux normes Qualiopi. Dans le cadre du respect du règlement d'examen, tout candidat peut saisir le référent handicap du certificateur pour aménager les modalités d'évaluation et obtenir l'assistance d'un tiers lors de l'évaluation. Les supports et le matériel nécessaires à la réalisation des évaluations pourront être adaptés. Sur conseil du référent handicap et dans le respect

Centre de Formation

des spécifications du référentiel, le format de la modalité pourra être adaptée. Sur avis motivé du référent handicap le jury de certification peut décider d'exempter le candidat de certains critères d'évaluation :

Dans la mesure où cela ne remet pas en question la capacité professionnelle globale du candidat,

Si le critère au regard de la nature du handicap n'a pas vocation à s'appliquer dans la pratique professionnelle future du candidat.

Ces deux critères étant cumulatifs.

MARCHÉS FINANCIERS

Cette formation a pour but :

- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux
- Concevoir des systèmes pour surveiller et contrôler les risques financiers continuellement.
- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux.
- Utiliser des méthodes quantitatives et des modèles pour évaluer l'impact potentiel des fluctuations de marché sur un portefeuille d'investissements.
- Établir des politiques et procédures pour évaluer et gérer les risques au sein d'un portefeuille ou d'une organisation financière.
- Comprendre et appliquer les réglementations de conformité et les normes de l'industrie.
- Développer des stratégies pour mitiger, transférer ou accepter le risque en fonction de l'appétit au risque de l'entreprise ou des clients.
- Proposer une couverture basée sur l'utilisation de produits dérivés
- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.
- Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.
- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.

Centre de Formation

- Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.

Public et prérequis

- **Public** : Professionnels de la finance, conseillers en investissement, traders et gestionnaires de portefeuille trouveront dans nos formations des ressources adaptées à leurs besoins. Toute personne intéressée par la finance et le trading
- **Prérequis** : Les candidats à la formation menant à un bloc de compétences, sont soumis à un entretien préliminaire et à la présentation d'un dossier démontrant leur capacité à suivre et valider la certification professionnelle : Ce dossier inclura une fiche synthétique de présentation du stagiaire et de son projet professionnel Et Être titulaire d'une certification de niveau 4 (Baccalauréat) à 6 (Bac+3) dans le domaine visé par le bloc de compétence ou un domaine proche, et justifier d'une expérience professionnelle de 12 à 48 mois minimum selon son niveau académique.

Pour obtenir le titre, les candidats peuvent cumuler les blocs de compétences. Afin de valider l'obtention du titre, il est impératif que le candidat justifie des prérequis nécessaires lors de l'inscription au dernier bloc de compétence permettant de se présenter au jury de certification du titre complet.

Objectif de formation

- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux
- Concevoir des systèmes pour surveiller et contrôler les risques financiers continuellement.
- Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux.
- Utiliser des méthodes quantitatives et des modèles pour évaluer l'impact potentiel des fluctuations de marché sur un portefeuille d'investissements.
- Établir des politiques et procédures pour évaluer et gérer les risques au sein d'un portefeuille ou d'une organisation financière.
- Comprendre et appliquer les réglementations de conformité et les normes de l'industrie.
- Développer des stratégies pour mitiger, transférer ou accepter le risque en fonction de l'appétit au risque de l'entreprise ou des clients.
- Proposer une couverture basée sur l'utilisation de produits dérivés
- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.
- Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.

Centre de Formation

- Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.
- Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.

Méthodes et moyens pédagogiques

Voir le programme de formation en annexe détaillant les moyens mis en œuvre pour réaliser techniquement l'action, suivre son exécution et apprécier ses résultats. Une feuille d'émargement signée par le(s) stagiaire(s) et le formateur, par demi-journée de formation, permettra de justifier de la réalisation de la prestation.

Méthodes pédagogiques :

- Méthode pédagogique expositive
- Méthode pédagogique active
- Méthode pédagogique participative

Moyens pédagogiques :

- Simulation
- Cas pratique
- Exercices
- Questionnaires

Ressources pédagogiques

- Supports de cours en PDF
- Supports vidéos
- Programme type

Moyens techniques

- Vidéoprojecteur
- Ordinateur connecté à internet
- Paperboard
- Cloud
- Vidéos préenregistré
- Espace personnel sur site internet

Accompagnement et suivi du stagiaire :

Centre de Formation

Le stagiaire est accompagné par le formateur du début à la fin de la formation.
Un suivi régulier permet d'ajuster si besoin les compétences abordées tout au long de la formation.

Dispositif d'évaluation en début de formation :

- Quiz de démarrage.

Dispositifs d'évaluation à la fin et après la formation

- Évaluations continues et une étude de cas finale pour évaluer
- les compétences pratiques selon le référentiel de la certification
- RNCP 37437
- Examen final
-

Sanction de la formation

En application de l'article L.6353-1 du Code du Travail, une attestation mentionnant les objectifs, la nature et la durée de l'action et les résultats de l'évaluation des acquis de la formation sera remise au(x) stagiaire(s) à l'issue de la formation.

Taux de satisfaction : 75%
Taux d'accomplissement : 75%

Phase 1: Évaluation des Besoins et Objectifs

1. Identification des parties prenantes
 - o Établir qui sont les destinataires des rapports (actionnaires, autorités de marché, etc.)
2. Définition des Objectifs
 - o Déterminer les informations clefs à inclure dans le rapport.

Phase 2: Conception du Tableau de Bord

1. Choix des Indicateurs de Performance (KPI)
 - o Sélectionner les KPIs pertinents pour mesurer la performance du portefeuille.
2. Design du Tableau de Bord
 - o Utiliser des logiciels comme Tableau, Power BI, ou Excel pour créer un tableau de bord visuellement attrayant et informatif.

Phase 3: Collecte et Traitement des Données

1. Identification des Sources de Données
 - o Trouver les bases de données ou les flux de données pour les KPIs choisis.
2. Automatisation de la Collecte

Centre de Formation

o Mettre en place des scripts ou utiliser des APIs pour collecter les données automatiquement.

Phase 4: Analyse et Synthèse

1.Vérification des Données

o Assurez-vous que les données collectées sont précises et complètes.

2.Synthèse des Données

o Utiliser des techniques statistiques pour synthétiser les données en insights actionnables.

Phase 5: Création des Rapports

1.Rédaction du Rapport

o Compiler les insights dans un rapport complet, incluant des graphiques et des tableaux.

2. Automatisation du Reporting

o Utiliser des logiciels ou des scripts pour automatiser la création et la distribution des rapports.

Phase 6: Conformité et Sécurité

1.Vérification de la Conformité

o Assurer que les rapports sont en conformité avec les normes réglementaires.

2. Mesures de Sécurité

o Implémenter des mesures de sécurité pour protéger les données sensibles.

Phase 7: Revue et Amélioration

1.Feedback des Parties Prenantes

o Solliciter des retours des destinataires des rapports pour améliorer les versions futures.

2.Révision Périodique

o Revoir régulièrement les KPIs, les sources de données, et les méthodes d'analyse pour s'assurer qu'ils restent pertinents et à jour.

En suivant ce programme, vous devriez être en mesure de concevoir un système de reporting robuste qui répond aux besoins de diverses parties prenantes, tout en respectant les réglementations en vigueur.

5.2 Modalités pédagogiques :

Cas pratique : Sur la base d'un cas d'entreprise donné, portant sur la gestion des opérations d'une salle des marchés, le candidat doit proposer un modèle de reporting (Etablissement des rapports périodiques de gestion, de performance)

5.3 Critères d'évaluation :

o Le système de reporting proposé permet d'optimiser la remontée des données.

o Le candidat propose des solutions de traitement de données appropriées au volume de données financières à exploiter en s'appuyant sur des méthodes et outils de traitement.

o Les solutions de traitement des données proposées sont adaptées au

Centre de Formation

volume de données à exploiter.

Programme détaillé

1) ÉVALUATION DES RISQUES DE MARCHÉS :

OBJECTIFS ET ACTIVITÉS PÉDAGOGIQUES :

Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux.

Concevoir des systèmes pour surveiller et contrôler les risques financiers continuellement.

1.1 Référentiel de compétences

Cartographier les différents risques économiques, opérationnels, financiers, et juridiques en les examinant et en les qualifiant afin d'évaluer leur niveau de criticité et leur impact sur l'entreprise.

PROGRAMME

Phase 1: Comprendre les Risques

1. Types de Risques

o Étude des différents types de risques: économiques, opérationnels, financiers et juridiques.

2. Importance des Risques

o Comprendre comment chaque type de risque peut impacter l'entreprise.

Phase 2: Outils et Méthodologies

1. Outils d'Évaluation des Risques

o Familiarisez-vous avec les outils comme les matrices de risques, SWOT, et les logiciels de gestion des risques.

2. Méthodologies

o Apprendre des méthodologies pour évaluer et qualifier les risques (ex: ISO 31000).

Phase 3: Risques Économiques

1. Évaluation Macroéconomique

o Analyser les indicateurs économiques et leur impact potentiel sur l'entreprise.

2. Risques du Marché

o Évaluer la volatilité et autres facteurs de risque du marché.

Phase 4: Risques Opérationnels

1. Processus Internes

o Examiner les processus opérationnels pour identifier les vulnérabilités.

2. Ressources Humaines

o Évaluer les risques liés à la gestion du personnel.

Phase 5: Risques Financiers

Centre de Formation

1. Risques de Crédit et de Liquidité

o Analyse des risques associés aux crédits et à la liquidité.

2. Exposition aux Devises et Taux d'Intérêt

o Évaluer les risques financiers liés aux fluctuations des taux de change et des taux d'intérêt.

Phase 6: Risques Juridiques

1. Contrats et Conformité

o Examiner les contrats et les obligations légales pour évaluer les risques juridiques.

2. Propriété Intellectuelle

o Évaluer les risques liés à la propriété intellectuelle et autres actifs intangibles.

Phase 7: Qualification et Cartographie

1. Qualification des Risques

o Utiliser une matrice de risques pour qualifier le niveau de criticité de chaque risque identifié.

2. Cartographie des Risques

o Créer une cartographie visuelle pour représenter le spectre des risques et leur impact sur l'entreprise.

Phase 8: Suivi et Mise à Jour

1. Suivi des Risques

o Mettre en place un système de suivi pour monitorer l'évolution des risques.

2. Mise à Jour de la Cartographie

o Actualiser régulièrement la cartographie en fonction des changements dans l'entreprise ou son environnement.

En suivant ce programme, vous serez en mesure de cartographier et de gérer efficacement les différents types de risques auxquels votre entreprise pourrait être confrontée.

1.2 Modalités d'information. Mise en situation professionnelle

À partir d'un cas donné portant sur l'évaluation des risques d'un projet d'investissement, le candidat doit cartographier les risques internes et externes et élaborer une courbe de distribution de probabilité des portefeuilles.

1.3 Critères d'évaluation :

o L'identification et l'analyse des risques s'appuient sur les standards réglementaires en vigueur (Bâle et Solvency, RGPD).

o L'identification des principaux risques s'appuie sur l'ensemble des paramètres de marché (taux, change, actions, matières premières, crédit...), et données internes de l'entreprise pour mesurer leur impact et de leur probabilité, en termes financier (solvabilité, liquidité, perte).

o Les risques sont cartographiés en termes de taux, de dividendes, de

Centre de Formation

volatilité, de corrélation et de variation de cours.

o Les résultats de l'analyse sont classifiés par niveau de criticité et présentés sous deux dimensions : probabilité et impact financier (taux, change, actions, matières premières, crédit...).

2) ÉVALUATION DES RISQUES DE MARCHÉS

OBJECTIFS ET ACTIVITÉS PÉDAGOGIQUES :

Identifier et mesurer les risques financiers associés aux marchés de capitaux.

Utiliser des méthodes quantitatives et des modèles pour évaluer l'impact potentiel des fluctuations de marché sur un portefeuille d'investissements.

2.1 Référentiel de compétences

Mesurer l'impact des différents risques pouvant peser sur les résultats de l'entreprise à l'aide de méthodes/programmes statistiques et mathématiques afin de mesurer la capacité de résistances de l'entreprise aux différentes situations pouvant survenir.

PROGRAMME

Phase 1: Fondements et Concepts

1. Types de Risques

o Comprendre les différents types de risques auxquels une entreprise peut être confrontée (risque de marché, de crédit, opérationnel, etc.).

2. Mathématiques Financières

o Acquérir des bases solides en statistiques et en mathématiques financières pour évaluer les risques.

Phase 2: Outils et Technologies

1. Logiciels Statistiques

o Apprendre à utiliser des logiciels comme R, SAS ou Python pour les analyses statistiques.

2. Techniques de Modélisation

o Se familiariser avec les méthodes de modélisation des risques comme le Monte Carlo.

Phase 3: Identification des Risques

1. Inventaire des Risques

o Identifier tous les risques potentiels qui pourraient affecter l'entreprise.

2. Classification des Risques

o Classer les risques en fonction de leur impact potentiel et de la probabilité de survenue.

Phase 4: Quantification des Risques

1. Mesure Statistique

o Utilisez des méthodes statistiques pour quantifier le niveau de chaque

Centre de Formation

risque identifié.

2. Indicateurs Clés

o Établir des indicateurs clés de performance (KPI) liés au risque pour une surveillance continue.

Phase 5: Modélisation et Simulation

1. Modèles Stochastiques

o Utiliser des modèles stochastiques pour simuler différents scénarios de risque.

2. Test de Résilience

o Effectuer des tests de résilience en utilisant les simulations pour voir comment l'entreprise réagit aux différents scénarios.

Phase 6: Analyse d'Impact

1. Mesure de l'Impact sur les Résultats

o Évaluer comment chaque type de risque pourrait affecter les résultats financiers de l'entreprise.

2. Analyse Sensibilité

o Effectuer une analyse de sensibilité pour évaluer comment de petites variations dans les variables peuvent affecter les résultats.

Phase 7: Rapport et Communication

1. Rapport de Risque

o Créer un rapport détaillé sur l'exposition aux risques et les plans d'atténuation.

2. Communication Interne

o Communiquer efficacement les résultats de l'analyse aux parties prenantes clés de l'entreprise.

Phase 8: Revue et Ajustement

1. Suivi des Indicateurs

o Surveiller en continu les indicateurs de risque pour détecter tout changement significatif.

2. Ajustements Stratégiques

o Réviser et ajuster les plans d'atténuation des risques en fonction des résultats du suivi.

En suivant ce programme, vous serez capable de mesurer avec précision l'impact des différents risques sur les résultats de l'entreprise et de mettre en place des stratégies efficaces pour atténuer ces risques.

2.2 Modalités d'information. Mise en situation professionnelle

À partir d'un cas donné ou réel, portant sur l'évaluation des risques d'un projet, le candidat évaluer qualitativement et quantitativement niveau de chacun des risques auxquels l'entreprise est exposée.

2.3 Critères d'évaluation :

o La méthodologie de calcul choisie est adaptée au type de risque mesuré (risque financier, risque opérationnel...).

Centre de Formation

- o La courbe fait apparaître les quatre éléments constitutifs de la Value at Risk (horizon temporel fixe, intervalle de confiance, montant investi et indicateur spécifique de risque au produit) afin de calculer le montant maximal de perte.
- o Le niveau d'exposition aux risques est bien évalué (risques cyber, risques opérationnels exogènes, risques d'images (RSE), fraudes de risques financier de chaque client/entreprise– indicateurs.
- o Les indicateurs de risques définis tiennent compte des corrélations existants entre les différentes variables de marché impliquées (risk metric).

3) DÉFINITION DES NORMES DE GESTION DES RISQUES

OBJECTIFS ET ACTIVITÉS PÉDAGOGIQUES :

Établir des politiques et procédures pour évaluer et gérer les risques au sein d'un portefeuille ou d'une organisation financière.

Comprendre et appliquer les réglementations de conformité et les normes de l'industrie.

3.1 Référentiel de compétences

Établir une stratégie de gestion des risques financiers en modélisant les paramètres de marché à partir de données historiques et de fonctions paramétriques. Proposer une couverture basée sur l'utilisation de produits dérivés afin de minimiser ou supprimer ces risques.

Développer des stratégies pour mitiger, transférer ou accepter le risque en fonction de l'appétit au risque de l'entreprise ou des clients.

Proposer une couverture basée sur l'utilisation de produits dérivés

PROGRAMME

Phase 1: Fondations Théoriques

1.Introduction aux Risques Financiers

o Comprendre les différents types de risques financiers: marché, crédit, liquidité, etc.

2. Produits Dérivés

o Apprendre les bases des options, des futures, des swaps et des autres instruments dérivés.

Phase 2: Outils et Ressources

1. Logiciels de Modélisation

o Se familiariser avec des outils comme MATLAB, R ou Python pour la modélisation financière.

2. Sources de Données

o Identifier des bases de données fiables pour les données historiques de marché.

Phase 3: Analyse Historique

1. Collecte de Données Historiques

o Collecter des données sur les indices de marché, les taux d'intérêt, etc.

Centre de Formation

2. Analyse des Tendances

- o Utiliser des techniques statistiques pour analyser les tendances historiques.

Phase 4: Modélisation Paramétrique

1. Modèles de Volatilité

- o Apprendre à utiliser des modèles comme GARCH pour estimer la volatilité.

2. Fonctions Paramétriques

- o Utiliser des fonctions paramétriques pour estimer des mouvements futurs.

Phase 5: Couverture avec Produits Dérivés

1. Stratégies de Couverture

- o Comprendre comment utiliser des options et des futures pour la couverture.

2. Optimisation

- o Utiliser des techniques d'optimisation pour minimiser le coût de la couverture.

Phase 6: Mise en Œuvre et Test

1. Simulations

- o Simuler la stratégie de gestion des risques dans différents scénarios de marché.

2. Backtesting

- o Utiliser des données historiques pour vérifier l'efficacité de la stratégie.

Phase 7: Examen et Ajustement

1. Suivi des Performances

- o Suivre la performance de la stratégie en temps réel.

2. Réajustement

- o Ajuster les paramètres du modèle et la stratégie de couverture selon les performances et les changements du marché.

Phase 8: Documentation et Rapport

1. Rapports de Performance

- o Créer des rapports détaillés sur l'efficacité de la gestion des risques.

2. Révisions Périodiques

- o Réviser et mettre à jour la stratégie selon les évolutions du marché et les besoins de l'entreprise.

En suivant ce programme, vous aurez une solide compétence dans l'établissement d'une stratégie de gestion des risques financiers.

3.2 Modalités d'information. Mise en situation professionnelle

À partir d'une problématique d'évolution macro-économique réelle ou fictive portant sur la gestion d'un risque financier, le candidat doit étudier la situation et formuler des recommandations pour optimiser la gestion des risques.

3.3 Critères d'évaluation :

- o Les stratégies et mécanismes de traitement des risques sont adaptés à la nature de chacun des risques.

Centre de Formation

- o Les risques financiers (taux, change, actions, matières premières, crédit) sont classifiés par niveau de criticité (impact, probabilité) et une ou plusieurs solutions de gestion sont proposées.
- o Les recommandations formulées permettent de limiter ou réduire les risques (environnementaux, RGPD, cyberattaques...) et sont adaptées à la nature de la problématique rencontrée par l'organisation.
- o Les avantages et inconvénients de chaque type de produit dérivé sont clairement identifiés.
- o Le coût de la stratégie proposée est évalué par le candidat

4) SUIVI ET CONTRÔLE DES OPÉRATIONS DE LA SALLE DE MARCHÉS OBJECTIFS ET ACTIVITÉS PÉDAGOGIQUES :

Surveiller des activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.

Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liée aux transactions sur les marchés financiers.

Analyser les performances des traders et des opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.

4.1 Référentiel de compétences

Superviser le traitement et l'enregistrement des opérations de marchés en mettant en place un système de contrôle interne et de suivi des activités afin de veiller au respect des obligations réglementaires imposées par la législation.

PROGRAMME

Phase 1: Fondations et Connaissances

1. Comprendre les Obligations Règlementaires

o Étudier les lois et règlements qui régissent les opérations de marché au niveau national et international.

2. Bases du Contrôle Interne

o Comprendre les principes fondamentaux du contrôle interne et de la gestion des risques.

Phase 2: Outils et Technologies

1. Systèmes de Gestion des Opérations de Marché

o Familiarisez-vous avec les systèmes de gestion des opérations et les logiciels de contrôle interne.

2. Sélection de Plateformes

o Choisir des plateformes qui permettent un suivi réglementaire efficace et

Centre de Formation

des fonctionnalités de reporting.

Phase 3: Mise en Place du Système de Contrôle Interne

1. Identification des Risques

o Établir un inventaire des risques associés aux opérations de marché et à la non-conformité réglementaire.

2. Procédures de Contrôle

o Établir des procédures de contrôle interne pour gérer ces risques.

Phase 4: Suivi des Activités

1. Monitoring en Temps Réel

o Mettre en place un système de surveillance en temps réel des opérations de marché.

2. Alertes et Notifications

o Configurer des alertes pour les activités suspectes ou non conformes.

Phase 5: Reporting et Documentation

1. Rapports Règlementaires

o Établir des modèles de rapports pour répondre aux exigences réglementaires.

2. Archivage des Données

o Mettre en place un système d'archivage sécurisé pour les données liées aux opérations de marché.

Phase 6: Revue et Amélioration Continue

1. Audits Internes

o Effectuer des audits réguliers pour évaluer l'efficacité du système de contrôle interne.

2. Mises à Jour Règlementaires

o Restez à jour sur les changements législatifs et ajustez les procédures de contrôle en conséquence.

Phase 7: Formation et Sensibilisation

1. Formation des Équipes

o Fournir une formation continue aux équipes sur les meilleures pratiques et les mises à jour réglementaires.

2. Évaluation des Compétences

o Effectuer des évaluations régulières pour s'assurer que l'équipe est compétente dans le respect des obligations réglementaires.

En suivant ce programme, vous pourrez non seulement superviser efficacement les opérations de marché, mais aussi veiller à ce que votre organisation soit en conformité avec toutes les obligations réglementaires pertinentes.

4.2 Modalités d'information. Mise en situation professionnelle

À partir d'un cas réel ou fictif, portant sur la gestion des opérations d'une salle des marchés, le candidat doit présenter un protocole de contrôle et de traitement des opérations.

Centre de Formation

4.2 Critères de l'évaluation

- o Le protocole respecte les normes techniques et réglementaires.
- o Les modalités de traitement et de contrôle des variations sont établies (risques d'intérêt, de change, boursières).
- o Les règles de comptabilisation des opérations inhérentes au respect de la réglementation sont appliquées (juste coût, distinction entre les instruments financiers traditionnels et les dérivés, critères ESG).

5) CONCEPTION DE SYSTÈMES DE REPORTING

OBJECTIFS ET ACTIVITÉS PÉDAGOGIQUES :

Surveiller les activités de négociation en temps réel pour assurer la conformité aux réglementations et politiques internes.

Gérer des risques opérationnels et de contrepartie liés aux transactions sur les marchés financiers.

Analyser les performances des traders et les opérations de marché pour améliorer les processus et stratégies.

5.1 Référentiel de compétences

Concevoir un système de reporting en mettant en place des tableaux de bords de suivi des portefeuilles d'actifs et outils de traitement automatique de données afin d'établir des rapports périodiques de gestion et de performance à destination des actionnaires et des autorités de marchés financiers.

PROGRAMME

Phase 1: Évaluation des Besoins et Objectifs

1. Identification des parties prenantes

- o Établir qui sont les destinataires des rapports (actionnaires, autorités de marché, etc.)

2. Définition des Objectifs

- o Déterminer les informations clefs à inclure dans le rapport.

XEILOS - 18 rue Costes et Bellonte, Bâtiment Espace Azur, 5e étage, 06200 Nice - siren 919 580 183 mail : contact@xeilos.fr

Phase 2: Conception du Tableau de Bord

1. Choix des Indicateurs de Performance (KPI)

- o Sélectionner les KPI pertinents pour mesurer la performance du portefeuille.

2. Design du Tableau de Bord

- o Utiliser des logiciels comme Tableau, Power BI, ou Excel pour créer un tableau de bord visuellement attrayant et informatif.

Phase 3: Collecte et Traitement des Données

1. Identification des Sources de Données

- o Trouver les bases de données ou les flux de données pour les KPIs choisis.

2. Automatisation de la Collecte

Centre de Formation

o Mettre en place des scripts ou utiliser des APIs pour collecter les données automatiquement.

Phase 4: Analyse et Synthèse

1.Vérification des Données

o Assurez-vous que les données collectées sont précises et complètes.

2.Synthèse des Données

o Utiliser des techniques statistiques pour synthétiser les données en insights actionnables.

Phase 5: Création des Rapports

1.Rédaction du Rapport

o Compiler les insights dans un rapport complet, incluant des graphiques et des tableaux.

2. Automatisation du Reporting

o Utiliser des logiciels ou des scripts pour automatiser la création et la distribution des rapports.

Phase 6: Conformité et Sécurité

1.Vérification de la Conformité

o Assurer que les rapports sont en conformité avec les normes réglementaires.

2. Mesures de Sécurité

o Implémenter des mesures de sécurité pour protéger les données sensibles.

Phase 7: Revue et Amélioration

1.Feedback des Parties Prenantes

o Solliciter des retours des destinataires des rapports pour améliorer les versions futures.

2.Révision Périodique

o Revoir régulièrement les KPIs, les sources de données, et les méthodes d'analyse pour s'assurer qu'ils restent pertinents et à jour.

En suivant ce programme, vous devriez être en mesure de concevoir un système de reporting robuste qui répond aux besoins de diverses parties prenantes, tout en respectant les réglementations en vigueur.

5.2 Modalités pédagogiques :

Cas pratique : Sur la base d'un cas d'entreprise donné, portant sur la gestion des opérations d'une salle des marchés, le candidat doit proposer un modèle de reporting (Etablissement des rapports périodiques de gestion, de performance)

5.3 Critères d'évaluation :

o Le système de reporting proposé permet d'optimiser la remontée des données.

o Le candidat propose des solutions de traitement de données appropriées au volume de données financières à exploiter en s'appuyant sur des méthodes et outils de traitement.

o Les solutions de traitement des données proposées sont adaptées au

Centre de Formation

volume de données à exploiter.

Modalités pédagogiques

25 heures de sessions de formation synchrones (en ligne ou en présentiel)

15 heures d'études de cas et exercices asynchrones

Modalités d'évaluation

Évaluations continues et une étude de cas finale pour évaluer les compétences pratiques selon le référentiel de la certification RNCP 37437

Examen final

