

Cas pratiques de gestion du risque de prix (M2)

OBJECTIFS :

- Mettre en place et maîtriser les techniques de gestion des contrats à prime
- Utiliser et maîtriser la gestion dynamique des options dans une optique de couverture

PROGRAMME

1. Maîtriser l'utilisation des contrats à terme sur le MATIF

- QCM initiation au marché à terme
- CAS 1 : passage d'ordres sur le marché à terme
- CAS 2 : gestion du compte marché à terme (caution et appel de marge)
- CAS 3 : arbitrage/couverture marché physique et marché à terme
- CAS 4 : calcul de la base

2- Mettre en place et gérer un contrat à prime

- Définition et principes de fonctionnement du contrat à prime ou swap de base
- Analyse de plusieurs exemples de contrats avec des primes fixe ou variable
- CAS 5 : synthèse « gestion du contrat à prime sur toute la campagne »

2. Maîtriser l'utilisation des options sur le MATIF

- Définition et principes de fonctionnement des contrats d'options
- QCM initiation aux options
- CAS 6 : faut-il utiliser des options ?
- CAS 7 : calculer la prime des options
- CAS 8 : faire une cotation d'option en volatilité
- CAS 9 : détermination des « points morts »
- CAS 10 : exercer ou ne pas exercer les options

3- La gestion dynamique des options dans une optique de couverture

- Principes d'utilisation des options selon une logique de couverture de risque de prix
- CAS 11 : construction de positions synthétiques et pratique des options pour un vendeur et un acheteur de marchandises
- CAS 12 : synthèse « gestion dynamique des options pour un Organisme Stockeur »

Conditions de réalisation :

Durée, dates & lieu : 1 jour, 26 mars 2009 ou 29 mai 2009 à Paris

Frais pédagogiques : 360 €/ht/personne

Intervenant : Partenaire Services Coop de France et SEPCO

Méthodes pédagogiques : exercices pratiques et résolution de cas par les participants

Evaluation : Synthèse écrite

Public : Tous publics et en particulier les commerciaux, les technico-commerciaux et les administrateurs de coopérative

Pré-requis : avoir suivi le module « Relever le défi de la gestion du risque de prix » ou équivalent

Bulletin d'inscription à retourner à SERVICES COOP DE FRANCE - A l'attention de Maryse LEROY

Nom-Prénom du responsable inscription : e.mail@.....

Participant : e.mail@.....

Fonction actuelle : Tél Fax

ENTREPRISE

Adresse

Inscription à la formation « Cas pratiques de gestion du risque de prix » le 26 mars 2009 ou 29 mai 2009 à Paris

Organisme à facturer