

LA GESTION POST TRADE DES OPÉRATIONS OTC

PROGRAMME

- INTRODUCTION
- RÉCENTES ÉVOLUTIONS RÉGLEMENTAIRES
 - Spécificité des produits OTC
 - Aperçu du processus de la gestion post-trade des opérations
 - Rôle des intervenants front office, middle office, back office, collateral management
- LES PROCESSUS DE LA GESTION DES OPÉRATIONS
 - Modélisation des opérations et suivi des événements durant le cycle de vie des transactions (reset, compensations, paiements d'intérêts, premiums, exercices)
 - Gestion des confirmations
 - Gestion des positions et calcul du PnL
 - Réconciliation entre les positions des équipes gérant/prime broker et middle
- LES ASPECTS COMPLIANCE
 - Contrôles post trade
 - Master agreement compliance
 - Différents types de conventions cadre
 - Convention cadre ISDA
 - Contrôle des limites du risque de contrepartie
- COLLATERAL MANAGEMENT
 - Contrôle du CSA (Credit Support Annex)
 - Valorisation quotidienne du portefeuille
 - Réconciliation des positions avec les contreparties
 - Gestion des appels de marge
 - Mécanisme du calcul des appels de marge
 - Suivi de la gestion du collatéral
- LES RAPPROCHEMENTS DE STOCK ET REPORTING
 - Le rapprochement dépositaire
 - Contrôle des paiements cash : achat / vente
 - Appels de marge
 - Régularisation des paiements
 - Saisie des flux exogènes
 - Le rapprochement valorisateur
 - Fournisseur de flux de données
 - Etat comptable d'un portefeuille (répartition sectorielle, devise, etc.)
 - Support aux calculs de l'actif
- OPÉRATIONS D'ASSISTANCE
 - Fonctions de l'assistant de trésorerie
 - Opérations de change
 - Instructions permanentes (standing instructions)
 - Investissement de la trésorerie résiduelle
 - Fonctions de l'assistant de gestion
 - reporting

DESCRIPTION

Cette formation présente les principaux éléments de la chaîne de traitement "post trade" pour les produits dérivés de gré à gré (OTC). Elle donne une vision intégrale des tâches de Middle Office, Back Office et Collateral Management dans une société de gestion d'actifs ou dans une banque de financement et d'investissement (BFI).

OBJECTIFS

- Maîtriser les principaux éléments de la chaîne "post trade" de traitement des opérations de marché
- Apprendre les spécificités de traitement Middle et Back Office des produits OTC
- Comprendre les mécanismes de confirmations et d'instructions

PUBLIC

- Front, middle et back office des sociétés de gestion et des BFI
- MOA et MOE dans les sociétés de gestion et BFI

NIVEAU

Intermédiaire

PRÉ-REQUIS

- Connaissance de base des produits financiers et des marchés financiers

FORMATIONS ASSOCIÉES

- PRÉPAREZ-VOUS
 - Instruments financiers
 - Marchés financiers (Niveau 1)
 - Comprendre les marchés financiers

FORMATEUR

Anas Tazi

DURÉE

2 jours

FORMAT

journée/soirée

PRIX

1 700€ HT

- contrôle des ratios et des risques
- LES FLUX ET LA MISE EN PLACE DES INSTRUCTIONS
 - Le mode de communication
 - le Swift, les IRL, les clés RMA et le BIC code
 - les contreparties
 - les cut-off
 - fonctionnement d'un dépositaire (sous-dépositaire, agent local)
 - circuit des souscriptions / rachats
 - Comment travailler sans le contexte Swift
 - contrôle des confirmations
 - simple ticket
 - suivi du collatéral
- CONCLUSION ET DISCUSSION