

## Calcul de l'exposition par la méthode de l'engagement

- Contextualiser la méthode de l'engagement dans la réglementation OPCVM
- Expliquer la raison d'être de la méthode de l'engagement
- Revoir le principe des dérivés
- Revoir le principe des techniques de gestion efficaces de portefeuille
- Interpréter la doctrine 2011-15
- Identifier les mécanismes de compensation et couverture
- Calculer l'engagement d'un portefeuille de dérivés actions
- Calculer l'engagement d'un portefeuille de dérivés de taux
- Calculer l'engagement d'un portefeuille de dérivés de change
- Calculer le risque global d'un portefeuille

### **VALIDATION DES ACQUIS PAR QUIZ**