



CONCEPTS AVANCÉS DE LA GESTION ACTIF-PASSIF (ALM)

PROGRAMME

- INTRODUCTION
- COMPLÉMENTS DE L'ANALYSE STATIQUE : AUTRES RISQUES DU BILAN
 - Risque de change
 - construction d'une impasse et couverture du gap
 - problématique du change NDF
 - Risque d'inflation
 - construction d'une impasse et couverture du gap
 - les produits d'inflation
- INDICATEURS DE RISQUES
 - Valeur Actuelle Nette du bilan
 - Sensibilité par classe d'échéance du bilan
 - Scenarii d'évolution des taux
 - Value-at-Risk
- STRATÉGIE ALM
 - Fermeture des gaps
Exemple. Fermeture horizontale / verticale du gap
 - Gestion des options cachées du bilan
Exemple. Les Plans Epargne Logement (PEL)
- COUVERTURE ALM ET NORMES IFRS
 - Le carve-out réglementaire
 - Fair Value Hedge
 - Cash Flow Hedge
- PRÉSENTATION DE L'ANALYSE DYNAMIQUE
 - Définition de l'analyse dynamique
 - Impasse de liquidité dynamique
 - Impasse de taux dynamique
 - Projection des taux d'intérêt
- PROGICIELS ALM
- CONCLUSION ET DISCUSSION

DESCRIPTION

Au-delà des notions de base de l'ALM bancaire, cette formation se focalise sur les aspects stratégiques de la gestion actif-passif, approfondit les connaissances des mesures de risques et explique les liens entre la comptabilité *fair value* et l'ALM.

OBJECTIFS

- Apporter une vision stratégique de la gestion actif-passif bancaire
- Approfondir les connaissances des techniques de l'ALM
- Comprendre le lien entre l'ALM et les normes comptables

PUBLIC

- Spécialistes de la fonction ALM, structuration
- Gestionnaires et ingénieurs risques
- Spécialistes comptables s'intéressant à la gestion des risques

NIVEAU

Avancé

PRÉ-REQUIS

Connaissance des principes et techniques de l'ALM

FORMATIONS ASSOCIÉES

- PREPAREZ-VOUS
 - Les fondamentaux de la gestion actif-passif (ALM)
 - Comprendre les taux d'intérêt
- ÉLARGISSEZ VOTRE CHAMP DE VISION
 - Gestion du risque de liquidité
 - Normes comptables internationales pour les métiers de la banque

FORMATEUR

Christel Pistre

DURÉE

1 jour

FORMAT

journée/soirée

PRIX

1 050 € HT