Pratique de la gestion de Trésorerie et ALM dans la banque

Identification, mesure et gestion des risques de liquidité et de taux d'intérêt



Cette formation s'adresse aux Gestionnaires des risques, Gestionnaires de Trésorerie, Responsables **ALM**, Contrôleurs internes.

Elle vise à vous permettre de :

Maitriser les techniques et les règles de gestion de l'ALM
Savoir mesurer et gérer les risques de liquidité, de taux d'intérêt et de change
Présentation des contraintes règlementaires et du contexte **algérien**
Mise en place d'un référentiel ALM
Il y a lieu de noter que des ateliers pratiques sur la modélisation des dépôts à vue sur **eviews 10.0** (approche de **box & jenkis**) et sur **Excel**.

Les principaux axes de l'atelier sont :

Le fondement théorique de la gestion actif passif
La mesure et la gestion du risque de liquidité en ALM
La mesure et la gestion du risque de taux d'intérêt en ALM
Le risque de change
La notion d'écoulement et travaux de modélisation des postes non-écheanciers : DAV, compte d'épargne, comptes débiteurs…
Aperçu sur la notion de prix de cession interne : le transfer pricing
Mise en place d'une unité ALM : Exemple d'un référentiel ALM
Étude de cas pratiques sur **PC** : application des différents instruments présentés pour le bilan de la banque sur Excel