



Gestion ALM et stress test de liquidité

Alcodeli
formation & conseil

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

Objectifs de la formation:

1. Maitriser les techniques de mesure des risques financiers
2. Se familiariser avec les stress test bancaires
3. Savoir Modéliser les postes non-échéanciers : dépôts à vue, épargne, comptes débiteurs ...
4. Savoir préparer les travaux du comité ALCO
5. Mise en place d'un référentiel ALM

Des ateliers pratiques sur la modélisation des dépôts à vue sur evIEWS 10.0 (approche de box & jenkins) et sur Excel.

Contenu de la formation:

La mesure et la gestion du risque de liquidité en ALM : les indicateurs avancés

Les indicateurs du risque de liquidité dans le nouveau cadre réglementaire : LCR, NSFR

Les indicateurs du risque de taux d'intérêt : Mesure de l'impact du risque de taux sur la valeur de la banque

Le risque de change

La dynamique du bilan bancaire et les sources de risques financiers

Le comité ALM ou Assets liability committee ALCO.

La notion d'écoulement et travaux de modélisation des postes non-échéanciers

Les stress test bancaires

La notion du prix de cession interne : le transfer pricing

Mise en place d'une unité ALM : Exemple d'un référentiel ALM

