



Gestion de Trésorerie & ALM

Alcodelfi

formation & conseil

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 permettre aux participants de :

1. Maîtriser les techniques et les règles de gestion de l'ALM
2. Savoir mesurer et gérer les risques de liquidité, de taux d'intérêt et de change
3. Présentation des contraintes réglementaires et du contexte algérien
4. 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 & jenkins) et sur Excel.

Les principaux axes de l'atelier sont :

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

