

RISQUE MANAGEMENT ALM ET RISQUE SALLE DES MARCHÉS

Introduction à la Formation

Plongez au cœur de l'univers complexe de la gestion des risques dans le secteur bancaire avec notre formation dédiée au «Risque Management ALM et Risque Salle des Marchés».

Cette expérience pédagogique intensive est spécialement conçue pour permettre aux professionnels de la banque d'explorer en profondeur les subtilités de la gestion des actifs et passifs ainsi que les défis associés aux salles des marchés.

Objectifs

Comprendre les principes fondamentaux de la gestion actif-passif (Asset Liability Management (A.L.M))

Explorer les distinctions entre les fonctions A.L.M et Trésorerie.

Acquérir des connaissances approfondies sur la gestion des risques liés aux taux, à la liquidité, et de change.

- ✓ **Avoir une Idée sur la Notion d'Appétence aux Risques avec ses Axes :**
 - a) **Risk Appetite Framework (R.A.F)**
 - b) **Risk Appetite Statement (R.A.S)**

- ✓ **Avoir une idée sur le C.O.S.O : Référentiel de base de la Gestion des Risques**

Apprendre à évaluer le capital et la solvabilité grâce à l'Internal Capital Adequacy Assessment Process (I.C.A.A.P) et la liquidité avec l'Internal Liquidity Adequacy Assessment Process (I.L.A.A.P).

Analyser les méthodes de couverture des risques de taux, de liquidité et de change.

- ✓ **Maitriser tous les Concepts Fondamentaux de base de la Fonction A.L.M**
- ✓ **Maitriser l'Utilisation des Instruments de Couverture des Risques de Marché**



Durée

5 Jours

du 15 Janvier 2024
au 19 Janvier 2024
avec des sessions
quotidiennes
de 4 à 5 heures.



Population cible

Cette formation s'adresse principalement aux professionnels du secteur bancaire souhaitant renforcer leurs compétences dans la gestion des risques, en particulier ceux travaillant dans les domaines de l'ALM et des salles des marchés.



RISQUE MANAGEMENT ALM ET RISQUE SALLE DES MARCHÉS

Le programme :

Journée 1 :

- » Gestion Actif Passif (G.A.P) & Asset Liability Management (A.L.M)
- » Organisation de la Gestion Actif-Passif & Le Comité A.L.CO
- » Distinction entre la Fonction A.L.M et la Fonction Trésorerie
- » Fondamentaux de la Fonction A.L.M
- » Préconisations des Actions Structurées

Journée 2 :

- » L'Appétence aux Risques « **RISK APPETIT** ».
- » Caractéristiques de l'Appétence aux Risques
- » Niveaux Stratégiques Tactiques et Opérationnels
- » Tolérance, Limites & Indicateurs
- » Risk Appetite Framework (**R.A.F**)
- » Risk Appetite Statement (**R.A.S**)
- » Référentiel COSO
- » L'Auto-Évaluation du CAPITAL/SOLVABILITE
- » **I.C.A.A.P** : Internal Capital Adequacy Assessment Process
- » L'Auto-Évaluation de la LIQUIDITE
- » **I.L.A.A.P** : Internal Liquidity Adequacy Assessment Process

Journée 3 :

- » La Gestion des Risques et la Fonction A.L.M
- » **Risque de TAUX** : Définition, Sources & Gestion du Risque de Taux
- » Méthode des Impasses & Méthode de Duration
- » Méthode du VAN & Méthode d'Ajustement Global
- » La Courbe des Taux
- » Gaps de Taux Fermes & Gaps de Taux Flottant
- » **Risque de LIQUIDITE** : Définition, Sources & Gestion du Risque de Liquidité
- » Impasses, Adossement & Consolidation du Bilan
- » Problèmes Spécifiques
- » **Les Contraintes Réglementaires** (L.C.R et N.S.F.R), **Ratio de LEVIER**
- » **Risque de CHANGE** : Définition, Sources & Gestion du Risque de Change
- » **Les Instruments de Couverture**
- » **SWAP**, Contrats à Terme, **FUTURE**, Contrats Optionnels, **FORWARD**
- » Options : **FLOOR** & **CAP** & **STRIKE**
- » Marchés de Change (**Marché au Comptant**, **Marché à Terme**)



Durée

5 Jours

du 15 Janvier 2024
au 19 Janvier 2024
avec des sessions
quotidiennes
de 4 à 5 heures.



RISQUE MANAGEMENT ALM ET RISQUE SALLE DES MARCHÉS

Le programme :

Journée 4 :

- » Optimisation de la TARIFICATION « **The PRICING** »
 - » Taux de Cession Interne « **Le T.C.I** »
 - » Coût Moyen des Ressources : Weighted Average Cost Of Capital « **W.A.C.C** »
 - » Rentabilité Ajustée par les Risques Risk Adjusted Return On Capital « **R.A.R.O.C** »
-

Journée 5 :

- » Risque de Taux niveau Entreprise & Risque de Taux niveau Investisseur
- » **Risque de Taux niveau Banque (Exemple Concret)**
- » Risque de Liquidité niveau Entreprise & Risque de Liquidité niveau Investisseur
- » **Risque de Liquidité niveau Banque (Exemple Concret)**



Ne manquez pas cette opportunité de perfectionner vos compétences et d'approfondir vos connaissances dans la gestion des risques ALM et des salles des marchés.

Inscrivez-vous dès maintenant pour une semaine intensive qui transformera votre approche de la gestion financière.