

## 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

- PRÉPAREZ-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