

L'INSTITUT DE FORMATION DE LA BOURSE DE TUNIS



ORGANISE UN SEMINAIRE SUR

LA GESTION ACTIF-PASSIF DE LA BANQUE ALM

NIVEAU 2

ANIMÉ PAR

*Responsable de la trésorerie et ALM d'une banque
Un Expert confirmé en gestion des produits de taux*

DATE : 23 & 24 JUIN 2021

SIEGE DE L'IFBT

Tarif : 480 DT/ HT

(TVA 19%)



www.ifbt.tn



(+216) 71 340 815



contact@ifbt.tn

OBJECTIFS

- Maitriser les techniques de mesure des risques financiers
- Savoir Modéliser les postes non-échéanciers : dépôts à vue, épargne, comptes débiteurs ...
- Maitriser la notion du prix de cession interne : transferpricing

PUBLIC CIBLE

- Gestionnaires des risques, Trésoriers, Responsables ALM, Contrôleurs de gestion.

FORMATEUR

- Responsable de la trésorerie et ALM d'une banque
- Expert confirmé en gestion des produits de taux
- Intervient régulièrement pour des institutions et des organismes de formation

PROGRAMME - JOURNEE DU 23 JUIN 2021

08H30-09H00	Accueil des Participants
09h00-11h00	<ul style="list-style-type: none">▪ La mesure et la gestion du risque de liquidité en ALM : les indicateurs avancés<ul style="list-style-type: none">• Les indicateurs du risque de liquidité• Les indicateurs du risque de taux d'intérêt : Mesure de l'impact du risque de taux sur la valeur de la banque<ul style="list-style-type: none">▪ La courbe des taux d'intérêt : présentation et techniques de détermination▪ Relation entre courbe de taux et risque de taux d'intérêt▪ Les notions de duration, sensibilité du portefeuille bancaire
11h00-11h30	Pause-café
11h30-14h30	<ul style="list-style-type: none">• La méthode de la valeur actuelle nette du bilan : sensibilité de la VAN• La sensibilité des fonds propres : la méthode des points de sensibilité• la dynamique du bilan bancaire et les sources de risques financiers

PROGRAMME - JOURNEE DU 24 JUIN 2021

08H30-09H00	Accueil des Participants
09h00-11h00	<ul style="list-style-type: none">▪ La notion d'écoulement et travaux de modélisation des postes non-écheanciers :<ul style="list-style-type: none">• DAV, compte d'épargne, comptes débiteurs ...• Ateliers et cas pratiques : modélisation par la méthode Box & Jenkins sur Eviews 10• Calcul des taux de fuite et cash-flow at risk
11h00-11h30	Pause-café
11h30-14h30	<ul style="list-style-type: none">▪ La notion du prix de cession interne : le transferpricing<ul style="list-style-type: none">• Présentation de l'approche et intervenants• Eléments de la politique du PCI• Méthode de détermination des PCI• Exemples et illustration calcul de PCI (ateliers sur Excel)

