

Pratique de la gestion de Trésorerie et ALM dans la banque

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 vous permettre de :

Maîtriser les techniques et les règles de gestion de l'ALM

Savoir mesurer et gérer les risques de liquidité, de taux d'intérêt et de change

Présentation des contraintes réglementaires et du contexte **algérien**

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 **views 10.0** (approche de **box & jenkins**) et sur **Excel**.

Les principaux axes de l'atelier sont :

Le fondement théorique de la gestion actif passif

La mesure et la gestion du risque de liquidité en ALM

La mesure et la gestion du risque de taux d'intérêt en ALM

Le risque de change

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

échéanciers : DAV, compte d'épargne, comptes débiteurs...

Aperçu sur la notion de prix de cession interne : le transfer pricing

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

Étude de cas pratiques sur **PC** : application des différents instruments présentés pour le bilan de la banque sur Excel

