

Mesure et gestion du risque de liquidité – FARI

Code produit : FARI

Niveau : Perfectionnement

Modalité : Presentiel

Durée (en heure) : 7.0

Tarif : 0,00 € HT

Eligible DDA : non

Public :

Toute personne intéressée
par la gestion du risque de
liquidité

Prérequis :

Aucun

Objectif

- Comprendre le risque de liquidité
- Retenir les bases de la gestion du risque de liquidité
- Comprendre les principaux ratios
- Recenser les outils de mesure et de suivi de la liquidité

Programme de la formation

1. Définition du risque de liquidité
 - Activité bancaire et liquidité
 - Crises de liquidité
 - Définition du risque de liquidité

- Liquidité : approche statique et approche dynamique : modèle d'activité et liquidité

2. Gestion du risque de liquidité

- Exigences réglementaires en termes de liquidité : surveillance prudentielle de la liquidité par l'ILAAP
- Outils
 - Gestion par les ratios
 - Tests de résistance à la liquidité
- Conséquences : organisation interne induite

3. Ratios principaux

- Ratios de court terme (LCR)
 - Actifs liquides
 - Coussin de liquidité
- Ratios de long terme (NSF)
- Observations des superviseurs

4. Mesure de suivi

- Outils de Mesure des Risques de Liquidité
 - Analyse des flux de trésorerie
 - Scénarios de stress de liquidité
- Validation des Modèles
 - Techniques de backtesting
 - Validation des hypothèses
- Outils et Techniques de Gestion des Risques de Liquidité
 - Gestion des actifs et passifs
 - Plans de contingence de liquidité

Moyens d'évaluation

- Evaluation des acquis de la formation par le biais de QCM et/ou d'exercices pratiques
- Questionnaire de satisfaction à chaud complété par chacun à l'issue du stage
- Questionnaire d'évaluation à froid complété par chacun entre 2 et 3 mois après le stage

Méthodes pédagogiques

- Exposés à partir d'un diaporama
- Echanges d'expériences
- Etudes de cas et exercices pratiques

AF2A - 64 Rue de Miromesnil, 75008 Paris

Copyright 2024 AF2A. Tous droits réservés.