

# LES ESSENTIELS DE LA GESTION DES RISQUES ALM

BA183

3 jours (21h) 1 990,00 €<sup>HT</sup>

## Objectifs

Maîtriser les méthodes d'évaluation du risque ALM • Maîtriser les méthodes de couverture et de gestion du risque ALM

### Profil Stagiaire(s)

Cette formation s'adresse à tous les collaborateurs travaillant pour les contrôles, et auditeurs externes

### Pré-requis

Cette formation nécessite d'avoir des connaissances dans la banque et l'environnement bancaire, en finance de marché, risques financiers, et en mathématiques et statistiques.

### Profil animateur(s)

Cette formation est animée par un expert en gestion des risques, finance d'entreprise et finance de marché



## PROGRAMME

### Fondamentaux du ALM

ALM définition et justification  
ALM piliers et objectifs  
Gestion du Bilan

### Gestion du risque de liquidité

Étude de cas  
Identification et mesure du Risque de liquidité  
Facteurs de risque de liquidité

### Gestion du risque de taux d'intérêt

Interest rate risk drivers  
Interest rate risk appetite  
Gouvernance du risque de taux d'intérêt

### Gestion du risque de Marché

Facteurs de risque de marché  
Objectifs et principes du risque de marché  
Market risk appetite  
VaR methodology overview

### Capital et Bale II/III

Basel III: Métrique de liquidité : LCR/RLCT  
Basel III: Métrique de liquidité : NSFR/RLLT  
Exigences minimales en matière de liquidité  
Liquidity coverage ratio

## Méthodes pédagogiques & Evaluation

Cette formation est très interactive et s'articule autour de nombreux cas concrets et exemples.

### Suivi & Evaluation

Pour assurer un suivi individuel, Demos a mis en place 2 types d'évaluation :  
Une évaluation de compétences en ligne en début et en fin de formation qui peut prendre différentes formes selon le contenu de la formation suivie : Tests d'évaluation des acquis, cas

## Contactez-nous

Conseiller formation  
09 88 66 10 00  
inscriptions@demos.fr

# LES ESSENTIELS DE LA GESTION DES RISQUES ALM

BA183

3 jours (21h) 1 990,00 €<sup>HT</sup>

pratiques, mises en situation, soutenance devant un jury pour les formations à finalité certifiante.

Une évaluation de la satisfaction de chaque stagiaire est réalisée en ligne. Cette évaluation est complétée par l'appréciation du formateur à l'issue de chaque session.

## Ressources pédagogiques

Support de formation, exercices...

## Moyens techniques

Nos centres de formation DEMOS, accessibles aux personnes à mobilité réduite, sont tous équipés :

- Salles de formation lumineuses, spacieuses, design, ergonomiques, mobiles et équipées d'écrans plasma, de PC portables/fixes si nécessaire à la formation suivie
- Accès au wifi haut débit sur l'ensemble des lieux
- Espace de colearning et webcorners
- Cafés, collations et rafraîchissement sont offerts

Les sessions "A distance" sont réalisées avec l'outil de visioconférence Teams, permettant au formateur d'adapter sa pédagogie.