



ESAA

Pins maritimes- Mohammadia
Alger - Algérie



GESTION ACTIF/PASSIF ALM

17 - 18 Septembre 2011
ESAA – Alger, Algérie

Durant ces 2 jours de séminaire, les aspects stratégiques, techniques et opérationnels de l'ALM seront examinés, notamment à travers l'analyse de ses deux grandes composantes; le risque de taux d'intérêt et le risque de taux d'intérêt et le risque de liquidité bancaire.

A la fin de ce séminaire les participants seront en mesure de :

- Appréhender la gestion globale du bilan à l'aide de cas pratiques.
- Maîtriser les mécanismes de mise en œuvre.

PARTICIPANTS :

Ce séminaire est recommandé aux personnes suivantes :

- Dirigeants de banques,
- Responsables ou futurs
- Responsables de la
- Fonction ALM, trésoriers,
- Responsables financiers,
- Contrôleurs de gestion,
- Responsables d'études réglementaire.

Animé par :

Henri JACOB
Animateur Afges





Programme

Le programme se déroulera de 9h00 – 17h00 quotidiennement

JOUR 1

Objectifs de la formation

- Appréhender la gestion globale du bilan à l'aide de cas pratiques.
- Maîtriser les mécanismes de mise en œuvre.

1. Introduction à la gestion actif / passif

- Les rôles de l'établissement financier.
- Management des risques bancaires.
- Le rôle de la gestion actif-passif.

2. Le risque de liquidité

- Définition et composantes.
- Retraitements et choix préalables.
- La mesure du risque de liquidité.

3. Le risque de taux d'intérêt

- Sources et effets du risque de taux d'intérêt.
- Retraitements et choix préalables.
- Mesure du risque de taux d'intérêt.

4. Le risque de change

- Définition et composantes.
- Mesure du risque de change.

5. La couverture du risque de liquidité

- Définition et problématique.
- L'adossement en liquidité.
- Les contraintes de la liquidité : les ratios de liquidité.
- Gestion du risque de liquidité : mesures à prendre pour assurer la sécurité du refinancement futur.

Biographie

Henri JACOB
Animateur Afges

1985 : Banque Lazard ; Analyste financier
Secteur des « Fusions-Acquisitions »

1988 : Cecogest; Bureau d'étude macroéconomique
et société de gestion de portefeuilles institutionnels,
notamment de fonds de pension américains.
Économiste, travaux sur les marchés financiers

internationaux, notamment mise au point « d'indicateurs de
prévision

De 1994 à 2001 : Optigestion; Directeur de recherche
Économiste et travaux sur les marchés financiers
internationaux

De 2001 à ce jour : Afges; Animateur

Pour information ou inscription :

Email : gfa.training@yahoo.com
www.gfa.dz

Téléphone : +213 (0) 6 64 54 94 71

Fax : +213 (0) 24 46 83 42



JOUR 2

6. La couverture du risque de taux d'intérêt

- Problématique.
- L'utilisation des principaux instruments dérivés (contrats à terme, options, swaps, FRAs) pour couvrir le risque de taux d'intérêt.
- Couverture globale du risque de taux d'intérêt : méthode des impasses, méthode de la durée.
- Risques de taux structurels des banques.

7. La couverture du risque de change

8. Le rôle des taux de cession internes

- L'éclatement notionnel des activités de la banque.
- Principes et calcul des taux de cession internes.

Résumé et clôture.

Déroulement de la Formation

La formation sera donnée sous forme d'exposés théoriques par le moyen de Power point en Alternance avec des débats pour permettre aux participants de poser des questions sur les points qui demeurent incompris.

Pré requis

Ce séminaire est souhaitable pour toute personne ayant une bonne connaissance des opérations bancaire et de la gestion financière.

Conception et animation des séminaires Bâle II, risques de marché, risques bancaires et ALM (en français ou anglais)

Formation :
Doctorat de 3ème cycle de Mathématiques
D.E.A. d'Économie Monétaire
Licence d'histoire

Publications :

- Management des risques bancaires
- Article : « Kernels in graphs with a clique-cutset »
- Article avec H. Meyniel : « About quasi-kernels »

Langues
Français - Anglais

Pour information ou inscription :

Email : gfa.training@yahoo.com

www.gfa.dz

Téléphone : +213 (0) 6 64 54 94 71

Fax : +213 (0) 24 46 83 42



ESAA
Ecole Supérieure Algérienne
des Affaires

Pins Maritimes - Mohammadia
Alger-Algérie

GESTION ACTIF/PASSIF ALM

17 - 18 Septembre 2011
ESAA – Alger, Algérie

Durant ces 2 jours de séminaire, les aspects stratégiques, techniques et opérationnels de l'ALM seront examinés, notamment à travers l'analyse de ses deux grandes composantes; le risque de taux d'intérêt et le risque de liquidité bancaire.

A la fin de ce séminaire les participants seront en mesure de :

- Appréhender la gestion globale du bilan à l'aide de cas pratiques.
- Maîtriser les mécanismes de mise en œuvre.

Formulaire d'inscription

Détails participant (institution financière)

Nous vous prions d'inscrire pour le séminaire ALM
du 17 - 18 Septembre 2011

Nom...../M^{elle}/Me
Prénom.....
Fonction.....
Compagnie.....
Adresse.....
.....
Téléphone..... Fax.....
Email

J'ai bien lu et compris les termes et conditions de mon inscription.

Signature..... Date.....

Frais DZD 26 500,00 HT/ Jour

Frais d'inscription inclus documentation et repas

La facture sera envoyée à l'inscription.

Détail Payment (chèque de banque – virement bancaire AGB
Bank

Agence Bousmail Compte N°:032 00006 2799001208 23)

Signature..... Date.....

Avertissement

Global Finance Algeria se réserve
le droit de changer ou d'annuler une
partie du programme publié pour des
raisons pédagogiques

Global Finance Algeria SARL

Siège social:
Coopérative Essaada n° 39
Ouled Fayet, 16 094
Alger - Algérie
R.C N° 09 1003095-16/00
NIF: 000916519049428

Protection de données

Toute information reçue par Global
Finance Algeria s.a.r.l sera gardée
confidentielle. Elle ne sera utilisée
que pour vous tenir informés de ses
produits et services.

Annulation

Toute demande d'annulation doit être
faite par écrit (e-mail ou fax) 4 jours
ouvrables avant la date de début des
cours
En cas de remplacement par une autre
personne, aviser du changement.

Pour information ou inscription :

Email : gfa.training@yahoo.com
www.gfa.dz

Téléphone : +213 (0) 6 64 54 94 71

Fax : +213 (0) 24 46 83 42