

● Mesure et gestion du risque de liquidité

Appliquer les obligations réglementaires relatives à la gouvernance, la mesure et le stress testing du risque de liquidité

Code
185

Durée
1 jour / 7 heures

Tarif Inter*
1 318 € HT

*Repas inclus (en présentiel)

PUBLIC

Toutes les fonctions opérationnelles d'un Front Office (Banques - Assurances - Sociétés de gestion/Asset Managers - Banques privées - CIF - CGP - Family office - Courtiers) - Managers des fonctions trésorerie et ALM dans la banque - Senior bankers - Relationship managers Institutionnels - Département Risk Management - Contrôle interne - Audit bancaire - Collaborateurs middle et back office - Juristes - Managers et collaborateurs de la fonction IT - Consultants SSII Banque/Assurance - Relation Investisseurs - Communication

PRÉ-REQUIS

Avoir de bonnes connaissances préalables sur le sujet

NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
 - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre

Objectifs pédagogiques

- Calculer et analyser les mesures de liquidité
- Gérer le risque de liquidité dans la banque
- Anticiper les implications réglementaires sur les exigences de gestion du risque de liquidité

Programme de la formation

Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur recevra vos objectifs de progrès.

Calculer et analyser les mesures de liquidité

Définir le risque de liquidité

- Liquidité transactionnelle vs liquidité de financement
- Interaction entre le risque de liquidité et d'autres types de risques
- La liquidité et la confiance du marché

Déterminer les sources du risque de liquidité

- Risque "Roll"
- Le risque de transformation des échéances
- Etude de cas : Northern Rock
- Concentration de financement
- Swaps de devises
- Etude de cas : les banques européennes et le financement USD
- Liquidité intra-groupe
- La viabilité de la Franchise
- Actif négociable
- Actif non négociable
- Hors bilan
- Liquidité intrajournalière

satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : care-formation@lefebvre-dalloz.fr

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

Gérer le risque de liquidité dans la banque

Etablir la gouvernance de liquidité

- La tolérance au risque de liquidité et appétit pour le risque
- Cadre de gouvernance

Mesurer la liquidité

- Analyse des écarts
- Modélisation des cash-flows incertains
- Autres mesures

Gérer les liquidités

- Diversification du financement
- Liquidité intrajournalière
- Etude de cas : Lehman Brothers
- Définition des prix de transfert des fonds
- Actifs tampons (buffers)
- Etude de cas : Silicon Valley Bank
- Stress Testing
- Key Risk Indicators (Indicateurs clés de risque) et les déclencheurs associés
- La planification d'urgence
- Etude de cas : LTCM

Anticiper les implications réglementaires sur les exigences de gestion du risque de liquidité

Respecter Bâle 3

- Le Liquidity Cost Ratio (LCR), l'aspect court terme
- Net Stable Funding Ratio (NSFR), les perspectives long terme

Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

A noter

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.

Prochaines sessions

...

PARIS

- 20 Nov. 2026

A DISTANCE

- 20 Nov. 2026

