
SEMINAIRE DE FORMATION INTERNATIONALE

VISIO-SEMINAIRE



PERFORMANCE TRESORERIE DE BANQUE

05 jours pour rehausser le costume du Trésorier de banque

- **Le Traitement des Opérations de Trésorerie**
- **La Gestion Opérationnelle ALM (Actif/Passif)**
- **La Pratique des Marchés et Produits Financiers**
- **La Gestion des Risques de Liquidité, de Taux et de Change**
- **L'Impact de Bâle 3 et le nouveau Dispositif prudentiel**

Visio-Séminaire, du 24 au 28 Novembre 2020

PERFORMANCE TRESORERIE DE BANQUE

05 jours pour rehausser le costume du Trésorier de banque

Participants

- Chef de Département de Trésorerie ;
- Trésoriers ;
- Traders ;
- Sales ;
- Responsables ALM ;

Objectifs

- Gérer efficacement les opérations classiques de trésorerie bancaire ;
- Pratiquer efficacement le marché international de change et monétaire ;
- Maîtriser la gestion et les risques de taux, de liquidité et de change ;
- Acquérir une approche pratique de la mesure et de la gestion du risque de taux et du risque de change.
- Maîtriser la gestion ALM.
- Cerner les accords de Bâle et le nouveau dispositif prudentiel;

Programme

MODULE 1:

LE TRAITEMENT DES OPERATIONS DE TRESORERIE BANCAIRE

I. LES PRINCIPES GENERAUX DE LA TRESORERIE BANCAIRE

1. Les principales opérations : couverture, arbitrage, spéculation
2. La gestion des risques (liquidité, taux, change, crédit...)
3. Le respect des normes de gestion et des normes prudentielles
4. Le contrôle des opérations de trésorerie bancaire : les limites liées aux risques

II. LES PRINCIPAUX INTERVENANTS ET LA GESTION DES OPERATIONS

1. La Banque Centrale
2. Les autres intervenants
3. Les différents marchés
4. Les systèmes de paiement et de titres

III. LES SPECIFICITES DES OPERATIONS DE TRESORERIE

1. Les prêts et emprunts interbancaires
2. Les bons du Trésor et les titres de créances négociables
3. Les opérations de pension
4. Les opérations de couverture

MODULE 2 :

LA GESTION ALM : PRATIQUE OPERATIONNELLE BANCAIRE

I. DEFINITION ET APPORT DE LA GESTION ALM DANS LA BANQUE

1. Définition.
2. Rôle.

II. GESTION DE LA LIQUIDITE

3. Définition des ratios de gestion.
4. Comment gérer la liquidité.
5. Améliorer la gestion du bilan de Trésorerie

II. LE MARCHÉ MONÉTAIRE.

1. Présentation du marché monétaire.
2. Instruments du marché monétaire.

III. LES OUTILS DE MESURE ET DE GESTION DES RISQUES

1. Stress test.
2. Maximum Cumulative Outflow.
3. Value at risk.

IV. OBJECTIFS ET RESPONSABILITE DE LA FONCTION : « GESTION ACTIF/PASSIF » ET DE L'ALCO

1. Structure de l'ALCO et thème de référence.
2. Taux de cession interne (FTP Process).

V. ORGANISATION D'UNE UNITE DE « MIDDLE OFFICE »

1. Présentation du Middle Office
2. Attributions du Middle Office (objectifs et missions)
3. Exemples de transaction et circuit d'une opération de change ou intermédiaire.

VI. TABLEAU DE BORD ALM

MODULE 3 :

LA PRATIQUE DU MARCHÉ FINANCIER INTERNATIONAL

I. LE MARCHÉ INTERNATIONAL DE CHANGE

1. Organisation
2. Acteurs
3. Produits

II. NOTION DE POSITION DE CHANGE

1. Définition d'une position de change
2. Détermination comptable de la position de change par la balance générale sous le PCB

III. INSTRUMENTS DE GESTION DES RISQUES DE CHANGE

1. Définition de risque de change

2. Opération au comptant ou spot
3. Opération à terme ou forward
4. Le swap cambiste
5. Le cross currency swap
6. Les options

IV. CADRE REGLEMENTAIRE DU MARCHE DE CHANGE

1. Les opérations en capital
2. Les opérations de transferts courantes
3. Les recettes d'exportation
4. Le suivi de la position extérieure
5. Les couvertures des opérations de transferts

MODULE 4:

RISQUE DE LIQUIDITE, RISQUE DE CHANGE ET RISQUE DE TAUX

I. LA GESTION DU RISQUE DE LIQUIDITE

1. Introduction
2. Méthodologies
3. Organisation

II. LA GESTION DU RISQUE DE CHANGE

1. Mesure du risque de change
2. Méthodes de couverture externe
3. Méthodes de couverture interne

III. LA GESTION DU RISQUE DE TAUX

1. Typologie et notion de structure par terme des taux Mesure du risque de taux
2. Méthodes de couverture du risque de taux

MODULE 5 :

BALE 2 & 3 ET LE NOUVEAU DISPOSITIF PRUDENTIEL

I. LES ACCORDS DE BALE ET L'ORGANISATION DE LA TRESORERIE

1. Les accords de bale
2. L'impact de Bâle 2 et 3 sur l'organisation de la Trésorerie bancaire

II. LA GESTION DE LA TRESORERIE

1. Le service des sales
2. Le service de la gestion actif-passif (ALM)

III. LA GESTION DU RISQUE DE MARCHE

1. Organisation du market risk
2. Outils de gestions du risque de marche

CONCLUSION

Intervenant :

RIB International

Réseau International d'Intelligence Bancaire

Abidjan, Cocody Riviera 30^{ème} Ardsmt - République de Côte d'Ivoire – CC 0909676T – RC : CI-ABJ-2012-B-9869

Tél : 00 225 20 01 05 07 – Cel : 00 225 40 50 99 90 - Fax : 00 225 22 44 38 01 – Email : info@rib-international.com – Site web ; www.rib-international.com

2 Consultants Internationaux animeront cette formation

1 Expert – Consultant International

Expert Banque & Finance ;

- Expert en Gestion de trésorerie bancaire;
- Expert Systèmes et moyens de paiement;
- Ancien Directeur de Trésorerie de banques ;
- Plus de 20 ans d'expérience bancaire acquise en Europe et en Afrique.

1 Expert – Consultant International

Certified FRM (Financial Risk Manager)

- Expert en Risk Management ;
- Expert en Trésorerie bancaire
- Spécialiste des travaux du Comité de Bâle.
- + 10 ans d'expérience bancaire acquise en Europe et en Afrique.

Style pédagogique :

- Visio-Séminaire en Classe virtuelle via plateforme électronique.
- Projection
- Alternance de mises en situation.
- Retours d'expérience et d'exposés
- Exercices

Documentation :

- Clé USB (document power point)
- Diplôme de fin de formation

Infos pratiques :

Durée : 30 heures (Du mardi 24 au samedi 28 Novembre 2020)

Horaires : 13h 00mn - 18h 30mn / pause : 16h 00mn - 16h 30mn

Nombre de places : 15

Inscriptions :

1) Imprimer le bulletin d'inscription, le remplir dûment et l'envoyer par mail à :
inscription@rib-inter.com

2) Inscription en ligne sous réserve de l'envoi du bulletin d'inscription via le site web :
www.rib-inter.com

3) Inscription par téléphone au **00 225 49 49 50 50** (suivie du bulletin d'inscription)

Tarifs :

850.000 f CFA HT

Remise de 10% à partir de 03 inscrits

S'inscrire en cliquant sur ce lien