



CERTIFICAT DE GESTION ACTIF-PASSIF

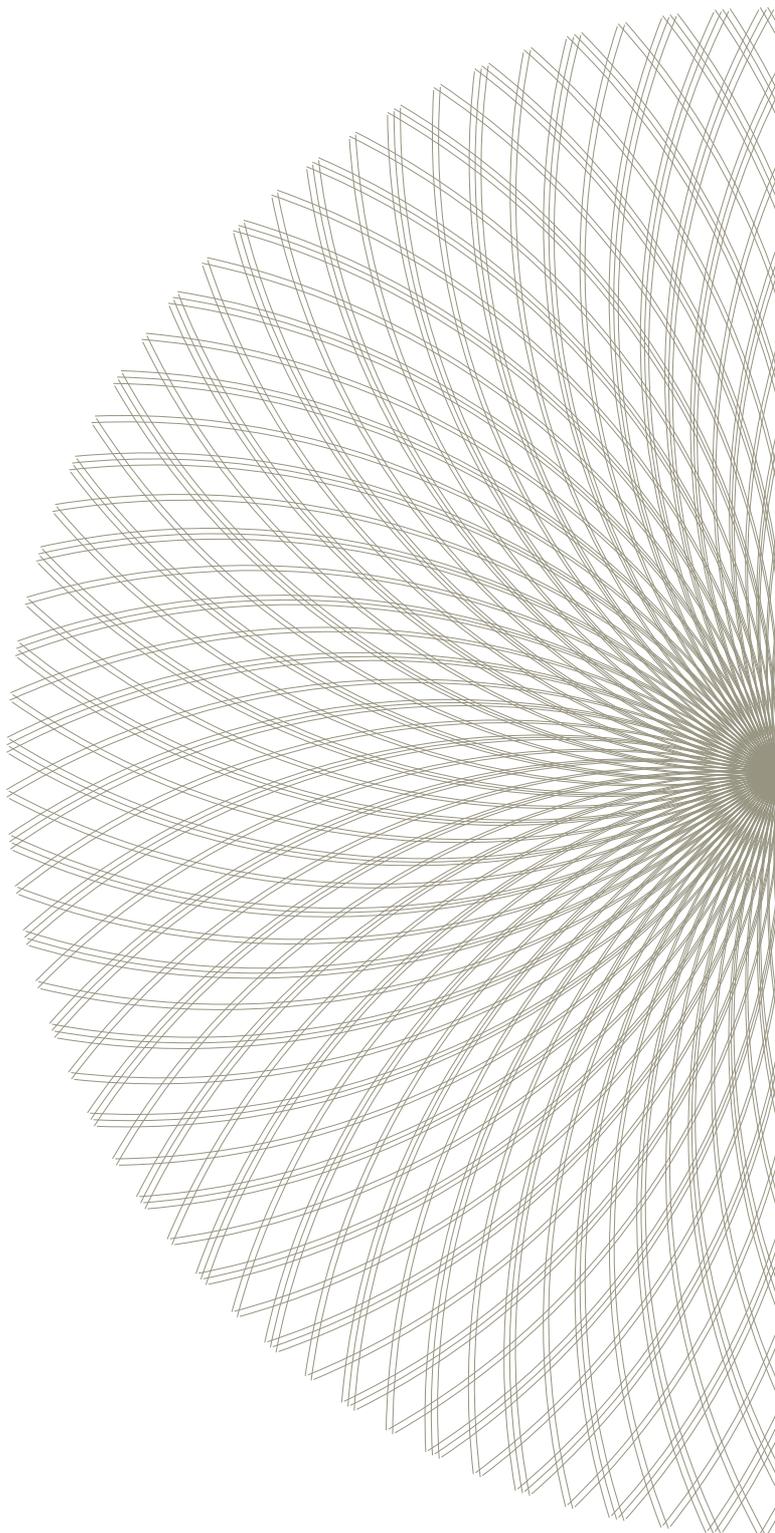
CGA-P

Formation continue

l'Association Française des
Gestionnaires Actif-Passif
(AFGAP)

En partenariat avec

Groupe des Écoles Nationales
d'Économie et Statistique
(GENES, ENSAE, ENSAI)



GENES

**LE CERTIFICAT
DE GESTION ACTIF-PASSIF**

Ce certificat a pour ambition de permettre à tous les cadres d'institutions financières, d'organes de supervision, de cabinets d'audit ou de conseil, d'accroître leur champ de connaissances, d'acquérir un véritable savoir-faire opérationnel et une très bonne maîtrise des techniques de gestion actif-passif. Notre ambition est aussi d'aider les professionnels à mieux appréhender les enjeux financiers de leur métier et aussi à évoluer dans leur entreprise ou leur institution.



POURQUOI CRÉER UN CERTIFICAT DE GESTION ACTIF-PASSIF ?

La gestion actif-passif constitue le « cœur du réacteur » d'une institution financière, dont l'importance s'est encore accrue pendant la crise financière : la gestion du risque de liquidité, de taux, de change et de l'ensemble des risques structurels propres aux activités d'une institution financière est une question centrale.

Pourtant, l'offre de formation sur ce domaine est très limitée car difficile à mettre sur pied. La gestion actif-passif ne peut s'exercer de façon pertinente que si elle rassemble des compétences multi-disciplinaires.

La gestion actif-passif a peu de sens sans une compétence comptable, sans la maîtrise des enjeux réglementaires et de la gestion des fonds propres, sans une compétence minimale en méthodes quantitatives et en modélisation des comportements de la clientèle, sans connaissance des marchés et produits financiers, sans une culture économique et enfin sans la compréhension profonde du fonctionnement et du cadre d'exercice des activités d'une institution financière.

Un champ de compétences aussi vaste explique le déficit de formation dans ce domaine : les « ingénieurs-quants » sont mal à l'aise sur les problématiques comptables, les comptables sont peu formés aux méthodes quantitatives propres aux marchés et produits de couverture, les économistes de formation ont du mal à faire le lien entre macro-économie et les activités opérationnelles d'une institution financière, les responsables de produits ou de clientèle connaissent peu la consommation de liquidité et les risques de taux engendrés par l'activité dont ils ont la charge, etc.

Ainsi, l'AFGAP s'associe avec le GENES pour créer une formation certifiante, à terme largement « européenne », avec les meilleurs professionnels de la Place.

LA FORMATION

Un programme complet couvrant tous les aspects de la gestion actif-passif et proposé par les meilleurs professionnels des banques françaises.

Le programme est totalement modulaire. La durée des modules varie d'une demi-journée à 2 jours. Selon leur maîtrise, les stagiaires peuvent suivre la totalité ou une partie seulement des modules.

Tous les modules intègrent des *case studies* pour permettre une appropriation très concrète des problématiques. De plus, des *workshop* complémentaires seront organisés pour donner le point de vue des auditeurs et commissaires aux comptes, des superviseurs, des experts des systèmes d'information ALM, etc.

La formation est principalement en français mais pourra, pour certains modules, être donnée en anglais.

Le suivi de tout le cursus et la réussite à l'examen de certification conduit à l'obtention d'un certificat AFGAP délivré par le Groupe des Écoles Nationales d'Économie et Statistique.

Le programme de module et l'intervenant sont supervisés par un responsable-métier issu du Conseil d'administration ou du Conseil scientifique de l'AFGAP.

Participent à ce programme comme concepteur, intervenant ou responsable-métier :

François Lecorfec (Société Générale), Michèle Peschet (ex-LCL), Xavier Agenos (Crédit Agricole Assurances), Marie Lemarie (Groupama), Thi mai huong Nguyen (Société Générale), Stéphane Denise (BNPP), Olivier Belorgey (Crédit Agricole SA), Antoine Frachot (GENES), Jean-Bernard Caen (Dexia Group), Nicolas Patrigot (BPCE), Nicolas Christophorov (BPCE), Christophe Couturier (ECOFI), Catherine Clausse (AMUNDI), Christian Jimenez (Diamant Bleu Gestion), Michel Bilger (Crédit Agricole SA), Thibaut de Roquemaurel (BNPP), Alexandre Heidmann (Société Générale), Hervé Akoun (HSBC), Abdelkader Bousabaa (GENES), Elisabeth Laure, Alexandre Adam (BNPP).



LES SESSIONS

1

Compréhension du bilan d'une banque, de son compte de résultat et liens avec les lignes d'activités bancaires

Responsable-métier :

Jean-Louis Godard (BNPP, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

4

Gestion des risques structurels 2 : le risque de taux d'intérêt

Responsable-métier :

Michel Bilger (Crédit Agricole SA, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

7

Couverture des risques structurels et ingénierie bancaire

Responsable-métier :

Olivier Belorgey (Crédit Agricole SA, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

10

Introduction au pricing des produits de couverture

Responsable-métier :

Antoine Frachot (GENES, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

2

Éléments de macroéconomie financière

Responsable-métier :

Christian Jimenez (Diamant Bleu Gestion, AFGAP)

Durée :

0,5 jour

3

Gestion des risques structurels 1 : le risque de liquidité

Responsable-métier :

Nicolas Christophorov (BPCE, AFGAP)

Durée :

1 jour

5

Gestion des risques structurels 3 : le risque de change

Responsable-métier :

Stéphane Landon (Société Générale)

Durée :

0,5 jour

6

Échéancement et modélisation des postes du bilan

Responsable-métier :

Stéphane Denise (BNPP, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

8

Modélisation du capital économique, taux de cession interne et tarification RAROC

Responsable-métier :

Jean-Bernard Caen (Dexia, AFGAP)

Durée :

2 jours

9

Comptabilité IFRS de la gestion financière

Responsable-métier :

Nicolas Patrigot (BPCE, AFGAP)

Durée :

1,5 jour

WORKSHOP

Session de formation additionnelle, non intégrée au parcours certifiant.

—
Système informatique de gestion financière

La gestion actif-passif vue par les superviseurs

La gestion actif-passif vue par les commissaires aux comptes

Best practice en termes d'organisation et de gestion ALM

ALLIANCE

GENES

Groupe des Écoles Nationales d'Économie et de Statistique

Le GENES (Groupe des Écoles Nationales d'Économie et de Statistique) est un établissement public d'enseignement supérieur et de recherche, placé sous la tutelle du Ministre de l'économie. Il regroupe deux grandes écoles d'ingénieur, l'ENSAE et l'ENSAI, 9 laboratoires de recherche en économie, finance-actuariat, méthodes quantitatives, statistique et sociologie, et un institut de formation continue et professionnel, le CEPE.

Le conseil d'administration du GENES comprend l'Insee, la Direction générale du Trésor, la Direction du Budget, la Direction générale de la Recherche et de l'Innovation (Ministère de l'Enseignement Supérieur et de la Recherche), la Banque de France, la Direction générale de la Compétitivité, de l'Innovation et des Services. Il comprend également des cadres dirigeants d'entreprise et des personnalités du monde académique français et international.



GENES

18, boulevard Adolphe Pinard - 75675 Paris Cedex 14 - FRANCE
Téléphone : +33 (0)1 41 17 64 79 - Fax : +33 (0)1 41 17 64 80

AFGAP

L'Association Française des Gestionnaires Actif-Passif

L'AFGAP est une association loi de 1901 créée en 1990. Elle rassemble près de 150 professionnels de la gestion actif-passif en France, venant de tous les secteurs financiers où cette discipline est pratiquée : banques, compagnies d'assurance-vie, entreprises financières, industrielles ou commerciales ayant des préoccupations de long terme (par exemple Réseau Ferré de France, EDF, Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, etc).

L'Association constitue maintenant depuis 20 ans un lieu actif d'échange d'informations et de réflexions relatives à la gestion actif-passif. Elle organise des débats sur les questions de régulation, de méthode, de pratique et s'est progressivement imposée comme interlocuteur crédible sur l'évolution des dispositifs réglementaires, comptables et prudentiels pour tout ce qui touche de la gestion de la liquidité, au risque de taux et de change au sein des bilans commerciaux des Banques et Assurances.

L'AFGAP entretient des relations avec les associations étrangères de gestionnaires actif-passif, en Europe et en Amérique. Elle apporte son soutien et son concours à de nombreuses manifestations intéressant les gestionnaires actif-passif.

L'Association est par ailleurs en contact permanent avec les chercheurs et les enseignants travaillant sur des sujets liés à la gestion actif-passif. Elle subventionne, après examen par son comité scientifique, des projets de recherche en gestion actif-passif.



www.afgap.org

Renseignements et inscription : Téléphone : 01 75 60 34 00 - conseil@lecepe.fr
www.lecepe.fr
