

## PROGRAMME DU CERTIFICAT DE GESTION ACTIF PASSIF

### ASSET LIABILITY MANAGEMENT (ALM11)

| <u>MODULES</u>  | <u>PERIODE</u>                                    | <u>DUREE</u> |
|---|---|--------------|
| 1. L'environnement macro-économique des banques   | 28 et 29 septembre (matin)<br>2020                | 1,5 jour     |
| 2. Compréhension du bilan d'une banque, de son compte de résultat en lien avec les lignes des activités bancaires | 29 septembre (après-midi) et<br>30 septembre 2020 | 1,5 jour     |
| 3. Echéancement et modélisation des postes du bilan   | 26 et 27 octobre (après-midi)<br>2020             | 1,5 jour     |
| 4. Gestion des risques structurels 1 : le risque de liquidité   | 16 novembre 2020                                  | 1 jour       |
| 5. Gestion des risques structurels 1 : le risque de taux d'intérêt  | 17 novembre 2020                                  | 1 jour       |
| 6. Gestion des risques structurels 3 : le risque de change  | 18 novembre (matin) 2020                          | 0,5 jour     |
| 7. Risque de taux : approfondissements, produits et stratégies de couverture                                      | 18 et 19 janvier (après-midi)<br>2021             | 1,5 jour     |
| 8. Comptabilité IFRS des instruments financiers et ratios prudentiels   | 19 janvier (matin) et 20<br>janvier 2021          | 1,5 jour     |
| 9. Modélisation du capital économique, taux de cession interne et tarification RAROC                              | 11 et 12 février 2021                             | 2 jours      |
| 10. Couverture des risques structurels et ingénierie bancaire   | 8 et 9 mars 2021                                  | 2 jours      |
| 11. Introduction à la gestion actif passif en assurance   | 25 et 26 mars 2021                                | 2 jours      |

**EXAMEN le 2 avril 2021**

