

Gestion actif-passif : analyser et gérer les risques en ALM bancaire

RS5601 · RS · Publiée

L'essentiel

Code(s) NSF	313m, 314r
Formacode(s)	41077
Type d'enregistrement	Enregistrement sur demande
Date d'enregistrement	24/11/2021
Date d'échéance	24/11/2026

Certificateur(s)

GROUPE DES ECOLES NATIONALES D ECONOMIE ET STATISTIQUE · SIRET : 13001422800089

Résumé de la certification

OBJECTIFS ET CONTEXTE

Le dispositif permet à des professionnels du monde de la finance de s'assurer de la stabilité du revenu financier en s'assurant de la maîtrise des risques de transformation de taux d'intérêt, liquidité et change et du respect des contraintes réglementaires

COMPÉTENCES ATTESTÉES

Analyser l'environnement macro-économique (politique monétaire, structures des taux d'intérêt...) afin d'estimer le risque de faillite et de prendre des mesures préventives en s'appuyant sur l'analyse des crises financières précédentes ou pouvant survenir

S'assurer du respect des attentes des autorités de supervision et macro-prudentielle afin de ne pas risquer de perdre son agrément en s'assurant du respect de l'ensemble des réglementations s'appliquant aux banques

Mesurer la solvabilité d'une banque afin d'estimer la solidité de l'établissement en analysant les équilibres du bilan et le montant des risques pris par l'établissement au regard de ses capitaux réglementaires

Comprendre les règles de la comptabilité bancaire (IFRS) afin de pouvoir analyser les éléments de bilan en examinant le rapport financier d'un établissement financier

Développer et utiliser des modèles d'écoulement de bilan en taux et en liquidité pour concevoir une tarification adaptée en mettant en œuvre un cadre de taux de cession interne cohérent

Mesurer les risques de liquidité, de taux et de change afin de proposer des mesures de pilotage et de couverture en calculant les différents indicateurs de risque (impasse, LCR, NSFR, stress tests)

Mettre en œuvre un cadre opérationnel de modèles de capital économique afin d'établir un outil d'allocation des fonds propres en implémentant une tarification RAROC et un suivi de la rentabilité

Maîtriser les principales méthodes de couverture afin de réduire le risque de taux en utilisant l'instrument adapté au risque (swap, cap, floor, swaption...)

Elaborer des opérations de refinancement structurées afin d'améliorer la gestion du bilan en proposant des structurations de titrisation ou de « covered bonds »

Voies d'accès

PRÉREQUIS À L'ENTRÉE EN FORMATION

Le candidat doit être un professionnel du secteur financier : départements ALM des directions financières des banques ; Le candidat doit avoir deux ans d'expérience professionnelle et avoir un niveau BAC+5 dans le domaine finance/économie/gestion)

Base légale

Date de décision	24/11/2021
Durée de l'enregistrement	5 ans
Date d'échéance de l'enregistrement	24/11/2026

Statistiques

Année	Certifiés	Dont VAE	Insertion 6 mois	Métier 2 ans
2021	8	—	—	—
2020	24	—	—	—
2019	14	—	—	—
2018	11	—	—	—
2017	10	—	—	—
2016	6	—	—	—
2015	14	—	—	—
2014	11	—	—	—

Liens avec d'autres certifications

ANCIENNES VERSIONS

RS2681

NOUVELLE(S) CERTIFICATION(S)

RS7717

Pour plus d'informations

LIEN VERS LE DESCRIPTIF

<https://www.lecepe.fr/certificats/gestion-actif-passif/>

Fiche officielle (France Compétences)

<https://www.francecompetences.fr/recherche/rs/5601/>

Où se former

Formations référencées	1
Organismes	1
Régions couvertes	1
Prix indicatif	9 950 €

Offre de formation — MonCompteFormation (Caisse des Dépôts), licence ouverte.

Entrées et sorties de formation

Entrées en formation	20
----------------------	----

Parcours menés à terme	8
Taux d'achèvement	40 %
Période	06/2022 – 09/2026

Entrées et sorties — Caisse des Dépôts (open data), tous organismes confondus.

Demande CPF — formations engagées

Dossiers CPF engagés	21
Montant total engagé	202 990 €
Coût moyen par dossier	9 666 €
Durée moyenne	116 h
Période	12/2021 – 05/2026
Entreprise	52 %
France compétences	38 %
Reste à charge titulaire	10 %

Formations engagées via le CPF — Caisse des Dépôts (open data), tous organismes confondus.