

## Focus Reporting réglementaires : LIQUIDITY REPORT

**22 juin 2022**

**Public cible :** Responsables des risques et des directions financières, équipes Finances et comptabilité notamment celles en charge du financement et du reporting, équipes du reporting réglementaire

**Prérequis :** Une connaissance minimale des opérations bancaires liées à la trésorerie est souhaitée.

**Objectifs :** Avoir une vue globale du reporting, des différents ratio concernés dans le pilotage actif / passif et la cohérence des exigences en matière de reporting réglementaires de liquidités. Intégrer les enjeux et les impacts pour chaque organisation.

**Durée :** demi journée de 3 Heures 30 – Horaire de 09 à 12 heures 30

**Intervenants :** Sylla Dienne - Directeur et Matthieu Le Guern - Associé conseil risques et finance chez ML ADVISORY

**Modalités et délais d'accès :** formation à distance à suivre sur notre espace Webex OCBF SF

**Méthodes mobilisées :** Documentation Powerpoint animée incluant des exemples, des illustrations, privilégiant la recherche de mutualisation des bonnes pratiques et favorisant les échanges entre participants.

**Modalités d'évaluation :** mises en situation, mini quizz et cas pratiques

**Tarifs :** 450 € HT soit 540 € TTC pour les adhérents OCBF SF, 540 € HT soit 648 € TTC pour les non adhérents.

15 Min	<p><i>Rappel des objectifs de la session, tour de table pour lister les attentes des participants, présentation des supports et cas pratiques, élargement de la liste de présence.</i></p>	
1h30	<p><b><u>PARTIE 1 : RISQUE DE LIQUIDITÉ</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Introduction au risque de liquidité</li> <li>• L'ILAAP</li> <li>• Tests de résistance à la liquidité</li> </ul> <p><b><u>PARTIE 2 : RATIO DE LIQUIDITÉ À COURT TERME</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>. Actifs liquides de haute qualité / Impacts</li> <li>. Reporting LCR <ul style="list-style-type: none"> <li>• Template LCR (C 76.00)- Couverture de liquidité (calculs Numérateurs)</li> <li>• Template LCR (C 76.00)- Couverture de liquidité (calculs Dénominateurs)</li> <li>• Total des sorties nettes de trésorerie</li> </ul> </li> <li>. Coussin de liquidité <ul style="list-style-type: none"> <li>• LCR Equilibrium /Excess buffer</li> <li>• Synthèse</li> <li>• Sorties nettes de trésorerie</li> <li>• Sorties / Entrées de trésorerie</li> </ul> </li> <li>. LCR appliquée modèles d'activité</li> <li>. Meilleures pratiques et pistes d'amélioration</li> <li>. Défis Bale III LCR / NSFR</li> </ul>	<p>Support Powerpoint, questionnaire et élargement,</p>

Pause 15 Mn

## Focus Reporting réglementaires : LIQUIDITY REPORT (suite)

1h30	<p><b><u>PARTIE 3: RATIO DE FINANCEMENT STABLE NET</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Définition</li> <li>• ASF / RSF</li> <li>• Traitements spécifiques</li> <li>• Rapports</li> <li>• Nouveaux changements avc CRR II</li> </ul> <p><b><u>PARTIE 4 : ALMM</u></b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Vue d'ensemble du cadre ALMM</li> <li>• Echelle de maturité (C66.00)</li> <li>• Concentration du financement par contrepartie ( C 67.00)</li> <li>• Concentration du financement par type ( C 68.00)</li> <li>• Prix pour différentes durées de financement (C 69.00)</li> <li>• Renouvellement du financement (C 70.00)</li> <li>• Concentration de la capacité de contreponds par émetteur ( C 71.00)</li> </ul>	<p>Support Powerpoint, Exercice Illustré QCU Synthèse</p>
------	---	---

**Accessibilité :**

*Les personnes qui rencontreraient des difficultés pour cause de situation de handicap, même léger, même provisoire, sont priées de bien vouloir nous consulter au moment de leur inscription, afin de nous permettre d'évaluer ensemble un dispositif d'adaptation de notre formation.*

**Date de mise à jour de la fiche : 30 mai 2022**

**Résultats obtenus : Nouvelle formation**

Vos contacts : [i.pheulpin@ocbf.com](mailto:i.pheulpin@ocbf.com) ; [ocbfaccueil@ocbf.com](mailto:ocbfaccueil@ocbf.com)— Téléphone : 01 44 69 81 70