

LES BASES DU MÉTIER

L'ÉVOLUTION DES INDICES IBOR

COMPÉTENCES VISÉES

- Connaître le contexte et les dispositifs de changement des indices Ibor
- Élaborer un plan d'adaptation aux calendriers d'évolution des indices

PROGRAMME

LE CONTEXTE DES INDICES IBOR

- L'historique des indices Euro, UK, USA
- Les usages produits : prêts, dérivés
- La contractualisation
- La remise en cause

LES DISPOSITIFS DE CHANGEMENT

- Le principe de base
- Les solutions UK Sonia
- Les solutions USA SOFR
- Les solutions Europe Ester
- Les solutions Suisse Saron
- Les solutions Japon Tonar

LE PLAN D'ADAPTATION AUX CALENDRIERS D'ÉVOLUTION DES INDICES

- Pour les pays déjà engagés (UK, Suisse, USA), comment lancer les changements contractuels et les usages de marchés
- Pour les pays en cours de préparation (Europe, Japon), comment anticiper les changements et s'adapter aux contrats en négociation
- La gestion des risques durant les périodes de transition

Étude de cas

- À partir d'exemples de contrats financiers, évaluer les périmètres des produits et des contrats à faire évoluer

Travail de groupe

- Définir une feuille de route suivant les enjeux par types de marchés financiers et de produits

1 jour (7 heures)
PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL
 ▶ 08/06/2021
 ▶ 08/11/2021

€ **Adhérent**
 790 € HT
Non-adhérent
 940 € HT
 Repas offert

OFFRE SPÉCIALE DE LANCEMENT
 - 10% DISTANCIEL

Public concerné
 Trésoriers, juristes,
 responsables financiers

Prérequis
 Pratique de la trésorerie
 et culture financière

Moyens pédagogiques et d'évaluation
 - Étude de cas
 - Travail de groupe
 - Auto-évaluation à chaud