

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**
850 € HT
Non-adhérent
940 € HT
Repas offert

 **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