

NOUVEAU

L'ÉVOLUTION DES INDICES IBOR



1 jour (7 heures)



> 05/06/2019
> 02/10/2019



Adhérent :
790 € HT
Non-adhérent :
940 € HT
Repas compris



Public concerné :
Trésoriers, juristes,
responsables financiers



Prérequis :
Pratique de la trésorerie et
culture financière



**Moyens pédagogiques,
techniques et
d'encadrement :**
Formation présentielle -
Étude de cas - Travail de
groupe

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 France, UK, US
- 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

Étude de cas

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

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

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

Travail de groupe

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