

LES BASES DU MÉTIER

L'ÉVOLUTION DES INDICES IBOR

COMPÉTENCES VISÉES

- Connaître le contexte et les dispositifs de changement des indices Ibor

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 NOUVEAUX INDICES

- Pour les transactions qui demeurent libellées en IBOR
 - comment procéder aux changements contractuels
 - utilisation des fall-back
- Pour les transactions dont l'indice a évolué ou pour les nouvelles transactions, implications du changement d'indice
 - settlement
 - couvertures
 - courbe de taux

1 jour (7 heures)
PRÉSENTIEL OU DISTANCIEL
 ▶ 07/06/2021
 ▶ 11/10/2021

Adhérent
 790 € 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
 - Formation présentielle
 - Auto-évaluation à chaud