

RISQUE DE LIQUIDITÉ

NOUS ANALYSONS LA PERTINENCE
DE VOTRE SYSTÈME DE SUIVI DU RISQUE
DE LIQUIDITÉ

➔ Revue des éléments actuels pris en compte par la société de gestion



Gestion du risque

Analyse du process de valorisation
par typologie d'actif.

Analyse de la méthodologie retenue
pour les différentes valeurs d'actif
(actions, obligations, futurs, OPCVM, ...)

Analyse des méthodologies et des calculs
mis en place afin d'estimer la liquidité à l'actif



Actif / Passif

Quelles sont les analyses
de passif pratiquées ?

Comment la liquidité de l'actif est analysée
au regard des exigences du passif ?



Risque extrême

Comment est géré
le risque « domino » ?

Seuils d'alertes et stress test.