



Market Risk and capital requirements: a hide and seek game with Jean-Paul Laurent

Practical INFORMATIONS

FORMAT
Matinale

DATE
3 novembre 2016

LIEU
**Institut Louis
Bachelier**
Palais Brongniart, 28
Place de la Bourse,
75002 Paris

PARTICIPATION
75 € HT
*(Association Loi 1901,
non assujettie à la TVA)*

INSCRIPTION
www.eifr.eu

CONTACT
contact@eifr.eu

L'EIFR est un organisme
de formation agréé sous
le numéro 11 75 45062
75

Almost ten years after the Financial Crisis, new rules regarding capital requirements for market risk are to be finalized. The computation of market risk-weighted assets is a key feature of the new framework. Hopefully, most banks and regulators agree on main principles, though huge uncertainty remains regarding calibration and thus size of inventories, reallocation of bank resources, new product development and business models of investment banks. Understandably, governance of a dual system involving standard approaches and internal risk models is challenging. We aim at discussing, in a not technical way, topics such as risk granularity, data and risk model governance and validation. We will also highlight issues related to the Quantitative Impact Studies (QIS) and Monitoring Exercises led by the Basel Committee and National Regulatory Authorities.

Jean-Paul Laurent is a professor at University Paris 1 Panthéon – Sorbonne (PRISM – Sorbonne) and member of the Financial Regulation Lab (LabEx ReFi).





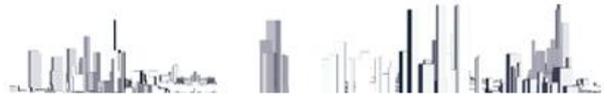
BIOGRAPHIE



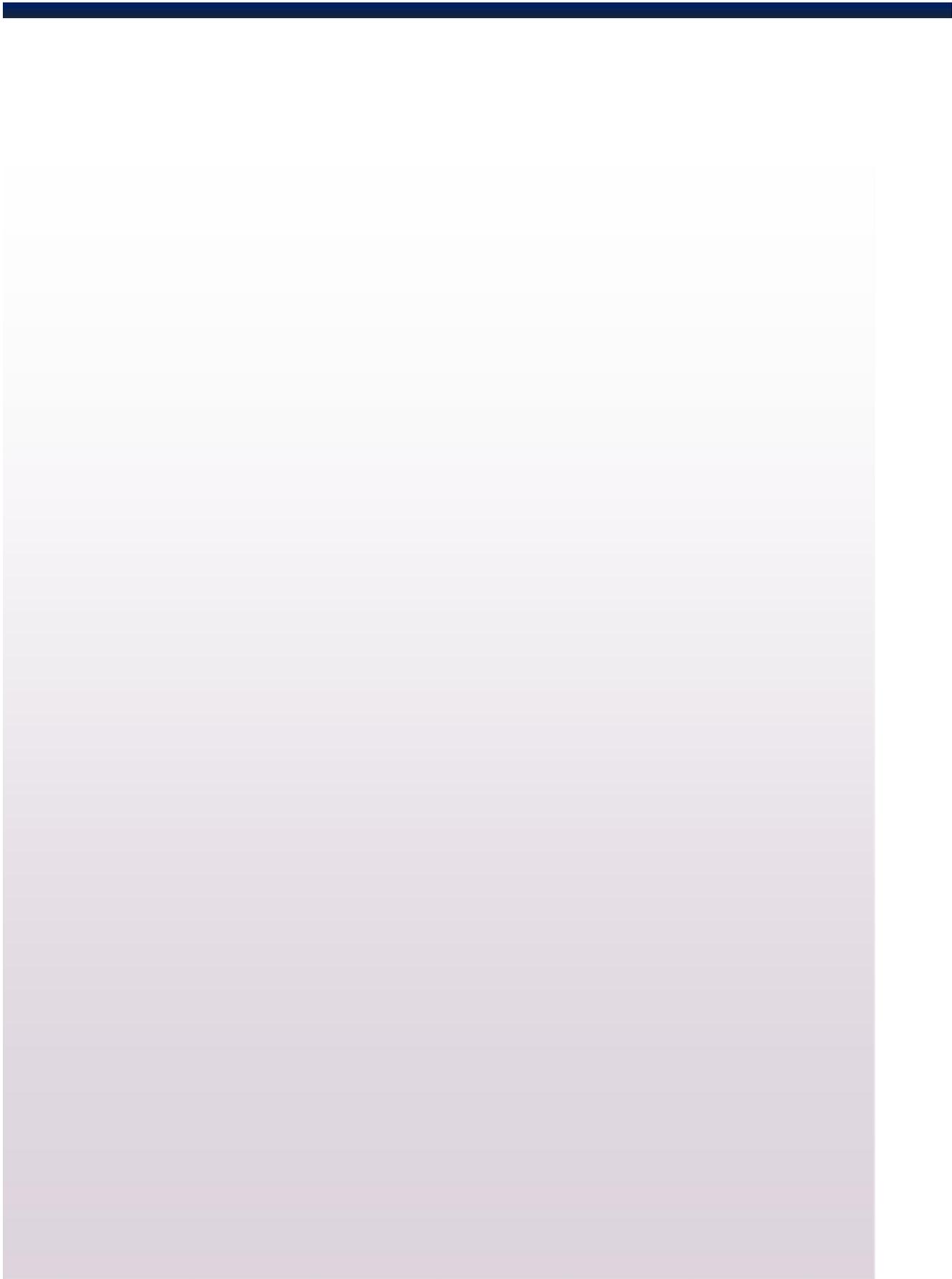
Jean-Paul LAURENT

Professor, UNIVERSITY PARIS 1 PANTHEON-SORBONNE AND MEMBER OF LABEX REFI

Jean-Paul Laurent is a Professor of finance at University Paris 1 Panthéon – Sorbonne and member of the Laboratoire d'Excellence (Labex) "Régulation Financière". Prior to this, he has been within ISFA actuarial school at University of Lyon and research professor at CREST, a leading academic institution in Paris. He has been a long time scientific consultant to BNP Paribas research teams. Jean-Paul has extensively published in academic and professional journals. He is known for contributions in the modelling and management of financial risks. He currently investigates the changes induced in this field by new banking and markets regulations.



NOTES





PRESENTATION EIFR

Objectifs & Missions

Développer et promouvoir une « *smart regulation* » à travers l'échange entre régulateurs et régulés.

- Favoriser le dialogue entre régulateurs et régulés,
- Organiser des conférences et séminaires pour améliorer la compréhension en matière de régulation financière,
- Contribuer à diffuser et à valoriser la recherche sur la régulation financière,
- Promouvoir la mise en œuvre des meilleures pratiques de la régulation financière en France et à l'étranger.

L'activité de l'EIFR

Périmètre couvert : régulation générale, marchés financiers, banque, assurance, gestion d'actifs, entreprises et financement de l'économie, économie durable, international

Conférences à Paris autour d'experts de la régulation :

- Matinales actualité : Députés européens, Rapporteurs sur les directives européennes, Régulateurs, des Experts présentent leur vision,
- Matinales recherche : un Académique présente ses travaux de recherche,
- Les RDV de la régulation : des Avocats exposent les points d'actualité.
- Ateliers : Ils traitent en 2 heures de thématique métier impacté par les évolutions de la réglementation et l'implémentation du calendrier prudentiel (format qui combine l'expertise d'un cabinet de conseil et un retour d'expérience client).

Séminaires de formation :

- Séminaires spécialisés pour les professionnels de la régulation et des risques (pour réunir dans un contexte d'échange régulateurs et régulés),
- Séminaires généraux sur la régulation financière pour les décideurs économiques et politiques (prochainement).

Actions à l'international pour promouvoir le modèle de régulation français et européen :

- Conférences internationales,
- Accueil de délégations de régulateurs étrangers.

Membres fondateurs :

Création en 2008 à l'initiative de Paris EUROPLACE avec les principaux acteurs de la place financière





CHIFFRES CLES

En 2015, l'EIFR aura organisé au total 33 évènements et rassemblé plus de 1850 personnes :

- 10 Séminaires : 615 participants
- 15 Matinales : 810 participants
- 8 Ateliers : 330 participants
- 1 Conférence annuelle : 100 participants
- 16 Conférences internationales : à Paris, Moscou, New York, Francfort, Washington, Lyon, Sotchi, Cracovie, Londres, Bruxelles, Rome

L'EIFR depuis son lancement en 2008, a organisé près de 190 évènements et touché plus de 10.000 participants.

CALENDRIER

Séminaire – 4e Directive anti-blanchiment et financement du terrorisme : quelles avancées ?	7 novembre 2016 Paris
Matinale - Risques Financiers : vers une approche neuronale ? avec Christian Schmidt	9 novembre 2016 Paris
Conférence annuelle – Why Europe needs to finalize the Banking Union to leverage a competitive CMU?	15 novembre 2016 Paris
Matinale - Mieux légiférer en droit financier : propositions du Haut Comité Juridique de la Place de Paris avec Alain Piétrancosta	25 novembre 2016 Paris
Matinale - La médiation financière : les défis d'une nouvelle articulation et les leçons du terrain ? avec Marielle Cohen-Branche	2 décembre 2016 Paris
Séminaire – Les rendez-vous de la régulation financière et de la conformité	8 décembre 2016 Paris
Séminaire - Bâle 4 ou les leçons à tirer des modèles internes vs standards	15 décembre 2016 Paris

INSCRIPTIONS

Retrouvez toute l'actualité de la régulation financière internationale (agenda européen et international, news, derniers textes règlementaires, conférence française et internationales, documents de référence, articles de recherche, etc...) sur notre site internet et les réseaux sociaux.

