



**INFORMATIONS  
PRATIQUES**

FORMAT

**Matinale**

DATE

**13 janvier 2017**

LIEU

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

PARTICIPATION

**75 € HT**

INSCRIPTION

**[www.eifr.eu](http://www.eifr.eu)**

CONTACT

**[contact@eifr.eu](mailto:contact@eifr.eu)  
01 70 98 06 53**

FORMATION

Nos séminaires sont imputables sur le budget de la formation professionnelle. L'EIFR est organisme de formation agréé sous le numéro 11 75 45062 75.

**Modèles internes :  
contribuer à la qualité des contrôles du risque**

Certes les modèles internes sont des outils de mesure plus que de comparaison. A ce titre, bien entendu, ils sont perfectibles et la courbe d'apprentissage depuis ces années de mise en œuvre sont un atout précieux pour l'industrie financière et pour la surveillance des risques. Mais surtout ces outils qui rentrent dans l'intimité des risques et de leur diversité sont très puissants comme méthode d'appropriation des risques par les équipes opérationnelles et par les contrôleurs.

Cet impact souvent oublié est à mettre en lumière à un moment où les modèles standards pourraient s'imposer en substituant l'analyse statistique à l'analyse des risques eux-mêmes. Cette matinale a pour double objectif de faire partager deux visions : une académique avec Dominique Guégan qui expliquera sa méthodologie d'application de la Value at Risk à la gestion des risques et une davantage opérationnelle avec Bertrand Hassani qui exposera sa stratégie interne et les modèles utilisés.

Enfin, la discussion s'ouvrira sur les perspectives de contribution à une meilleure qualité des contrôles des risques offertes par les propositions de Bâle 4.



BIOGRAPHIES



## Dominique GUEGAN

### **Professeur émérite, UNIVERSITE PARIS I PANTHEON-SORBONNE ET MEMBRE DU LABEX REFI**

Prof. Dominique Guégan is Emeritus Professor at the University Paris1 Panthéon-Sorbonne. Her domains of expertise are: Risk measures in finance – Financial Regulation - Deterministic dynamical systems- Nonlinear time series - Non-parametric statistics – Contagion and Systemic risks – Extreme value theory – Fintech technology. She belongs to the LaBex “Financial Regulation”, through the Finance team of the University Paris 1 – CES and she is affiliated to the Financial Engineering Department inside NYU (New York, USA) and to the IPAG Business School (Paris and Nice, France). She has supervised 37 PhD and published 10 books, 110 academic papers and 30 chapters. She also participates to several international projects supported by Governments or supra-national bodies, and she is regularly invited in the most well known universities in Europe, USA, Australia and Asia.



## **Bertrand HASSANI**

### **Global Head Of Research and Innovation, BANQUE SANTANDER ET MEMBRE DU LABEX REFI**

Dr. Bertrand Hassani is a risk measurement and management specialist. He is currently the Global Head of Research and Innovations (Grupo Santander) for the risk division. In this role, Bertrand aims at developing novel approaches to measure risk (financial and non-financial) and integrating them in the decision making process of the bank (business orientated convoluted risk management), relying on methodologies coming from the field of data science. He is an active associate researcher at Paris 1 Pantheon-Sorbonne University. He wrote several articles, chapters and a book dealing with Risk Measures, Risk Modelling, and Risk Management.



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 2016, l'EIFR aura organisé au total 46 évènements et rassemblé plus de 2000 personnes :

- 12 Séminaires : 650 participants
- 20 Matinales : 870 participants
- 11 Ateliers : 450 participants
- 1 lancement de FinTech forum avec Dassault Systèmes
- 1 déjeuner de travail avec Verena Ross ESMA
- 1 Conférence annuelle : 100 participants
- 3 Conférences internationales : à New York, Francfort et Londres

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

### CALENDRIER

<a href="#">Matinale - Garantie des dépôts : Convergence en Union européenne ? avec Thierry Dissaux</a>	<b>31 janvier 2017</b> Paris
<a href="#">Matinale - Normes comptables européennes : l'EFRAG après le rapport Maystadt, nouvelle feuille de route</a>	<b>23 février 2017</b> Paris

### INSCRIPTIONS

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