ASSOCIATION EUROPE FINANCES RÉGULATIONS

INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT
Présentiel

MODE DE PARTICIPATION
Refinitiv
Paris - 75009
6/8 bd Haussmann

DATE
24/01/2019

LIEU
6/8 bd Haussmann
Paris 75009

PARTICIPATION
250 €

INSCRIPTION
www.aefr.eu

CONTACT
contact@aefr.eu
01 70 98 06 53

Atelier

FRTB et réforme des risques de marché, quelle finalisation ?

Qu'apportera le texte final du nouveau cadre des risques de marché défini par Bâle III, attendu prochainement ? La FRTB (Fundamental Review of the Trading Book) représente un changement de fond dans la gestion des risques de marché, avec d'importants impacts en termes de gouvernance, de charge en capital, de modélisation du risque, d'infrastructure IT.

Une approche basée sur les sensibilités (SBA), le remplacement de la Value at Risk (VaR), qui a montré ses limites lors de la crise financière de 2008, par de nouvelles mesures de risques (Expected Shortfall, Default Risk Charge) implique la refonte des méthodes de calcul et une meilleure granularité des données.

Quelles sont les nouvelles contraintes règlementaires qui s'imposent aux établissements bancaires et financiers, quel est le calendrier de mise en œuvre, et comment se préparent ils à ce nouveau dispositif ? Quelles approches, modèles internes ou standardisés, vont-ils adopter ?

L'ACPR commentera le cadre règlementaire de la FRTB et ses dernières évolutions, puis Mazars évoquera l'introduction du dispositif dans les établissements et les problématiques de mise en œuvre. Le fournisseur de data Refinitiv-Financial & Risk Business of Thomson Reuters is now Refinitiv-présentera ses solutions pour le pilotage des risques et BNP Paribas son expérience de grande banque internationale dans la gestion de cette règlementation.

Public visé

- Directions des Marchés, Trading desks
- Directions des Risques
- Directions financières
- Fonctions conformité
- Avocats et Sociétés de conseil

OBJECTIFS PÉDAGOGIQUES

- Connaitre les règles d'application de FRTB et anticiper les prochaines étapes règlementaires
- Bénéficier des expertises dans la mise place des systèmes et des problématiques qui se posent
- Analyser les impacts à attendre dans les calculs et le suivi des risques de marché

PROGRAMME

8h30	**Introduction**
8h45	**Le cadre règlementaire de FRTB et ses évolutions : modèles, capital, calendrier** Intervenants: Frederic GUEVEL (ACPR)
9h15	**Les zones « sensibles » du texte et ce que disent les chiffres (QIS)** Intervenants: Pauline PELISSIER (Mazars UK) Progress status : où en sont les établissements, vers quoi s'orientent-ils ?
9h45	**Data pooling, l'importance des données et solutions au pilotage des risques** Intervenants: Eric BABULLE (Refinitiv)
10h15	**Les impacts business et risques** Intervenants: Jacques DEBES (BNP Paribas)
10h45	**Questions / Réponses / Conclusion**