ASSOCIATION EUROPE FINANCES RÉGULATIONS

## INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT
**Présentiel**

MODE DE PARTICIPATION
**Paris**
**Palais BRONGNIART, Place de la Bourse - 75002 Paris**

DATE
**7 fevrier 2012 de 8h30 a 14h00**

LIEU
**Palais BRONGNIART, Place de la Bourse - 75002 Paris**
**Paris**

PARTICIPATION
**0 €**

INSCRIPTION
**www.aefr.eu**

CONTACT
**contact@aefr.eu**
**01 70 98 06 53**

# Séminaire

# MODELES DE RISQUES DE MARCHE ET RISQUES DE CONTREPARTIE et leur validation

**Ce séminaire a pour object :**
En vue de leur utilisation à des fins prudentielles, les modèles de mesure et de gestion des risques de toutes natures (marché, crédit,) développés en interne par les établissements font l'objet d'un examen approfondi par le régulateur lors des enquêtes sur place.
Programme

## OBJECTIFS

- Résumer les évolutions réglementaires relatives aux risques de marché et de contrepartie (impacts de Bâle 2.5 et Bâle 3),
- Expliciter brièvement la problématique et la finalité de leur examen par le superviseur,
- Analyse comparée avec la Bafin,
- Se focaliser sur quelques problèmes principaux rencontrés lors de l'examen selon le type de modèles examinés,
- Offrir un cadre de dialogue ouvert entre régulateurs et profession sur les thèmes évoqués.

## PROGRAMME

**I] Les évolutions réglementaires relatives aux modèles de mesure des risques de marché et de contrepartie**
CRD 3, CRD 4 et règlement CRR

**II] La mise en œuvre de ces modèles par l'Industrie**
La VaR (*Value at Risk*) stressée
Les dispositifs d'IRC (*Incremental Risk Charge*) et de CRM (*Comprehensive Risk Measure*)
Le modèle EEPE (*Expected Positive Exposure*)

**III] Les principaux constats et difficultés rencontrés par le Régulateur dans le processus d'examen de ces modèles**
Le point de vue français
Le point de vue allemand

## PUBLIC VISE

- Equipes d'inspection générale et d'Audit interne,
- Direction des Risques,
- Equipes de «Product Control»,
- Cabinets de conseil et d'audit.