

MODÈLES DE RISQUES DE MARCHÉ ET RISQUES DE CONTREPARTIE et leur validation

7 février 2012

Palais Brongniart de 8h30 à 14h00

(un déjeuner buffet sera proposé)

PRESENTATION

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.

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.

PUBLIC VISÉ

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

PARTICIPATION : 600€

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

INTERVENANTS :

Cong Khanh TRAN, Responsable de la Cellule de Contrôle des Risques Modélisés (CCRM), Secrétariat Général de l'ACP

Stéphane BOIVIN, Chairman du Subgroup on Market Risk de l'EBA, Direction des Affaires internationales, Secrétariat Général de l'ACP

Pascal GIBART, Responsable des Méthodologies, Direction des Risques, Crédit Agricole CIB

Nathalie BOUEZ, Co-Responsable de Risk Architecture au sein de Risk Capital Markets/Group Risk Management, BNP Paribas

Pierre GAYE, Responsable adjoint de « Risks on Market Activities », Direction des Risques, Société Générale

Ingo RECHWEIN, Risk Modeling Department, Bafin

Isabelle THOMAZEAU, Membre de la CCRM

Fabien RENAULT, Membre de la CCRM

Gaëlle CHALAS, Membre de la CCRM