



INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT
Face to face

MODE DE PARTICIPATION
**Institut Louis Bachelier
(4ème étage)
Paris - 75002
Palais Brongniart, 28,
place de la Bourse**

DATE
Friday 13 January 2017

LIEU
**Palais Brongniart, 28,
place de la Bourse
Paris 75002**

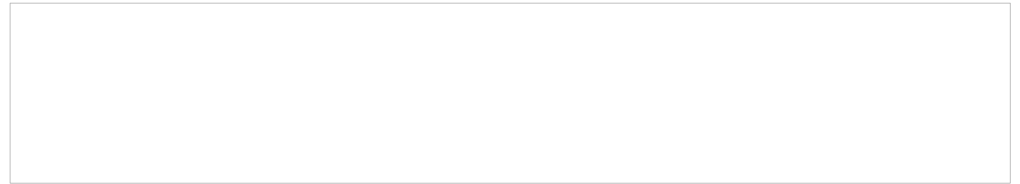
PARTICIPATION
€75

INSCRIPTION
www.aefr.eu

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

Morning

Modèles internes : contribuer à la qualité des contrôles du risque avec Dominique Guégan et Bertrand Hassani



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.