



## INFORMATIONS PRATIQUES

### FORMAT

Face to face

### MODE DE PARTICIPATION

Paris  
Palais BRONGNIART,  
Place de la Bourse -  
75002 Paris

### DATE

February, 7th 2012 -  
8:30am to 2:00pm

### LIEU

Palais BRONGNIART,  
Place de la Bourse -  
75002 Paris  
Paris

### PARTICIPATION

€0

### INSCRIPTION

[www.aefr.eu](http://www.aefr.eu)

### CONTACT

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



# Seminar

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

### Ce séminaire a pour objet :

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.