



INFORMATIONS  
PRATIQUES

FORMAT  
**Présentiel**

MODE DE PARTICIPATION  
**Paris**  
**Palais Brongniart (la**  
**Bourse), Paris**

DATE  
**16 février 2010**

LIEU  
**Palais Brongniart (la**  
**Bourse), 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**



## Séminaire

### L'Examen des Modèles de Risque par le Régulateur- Analyse de cas

Formation proposant une meilleure compréhension de la manière dont le régulateur bancaire enquête sur les modèles de mesure et de gestion des risques.

Les modèles de valorisation des produits complexes tout comme 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.

Les objectifs du séminaire visent à :

- Expliciter brièvement la problématique et la finalité de ces examens ;
- Se focaliser sur quelques problèmes principaux rencontrés lors de ces examens, selon le type de modèles examinés ;
- Offrir un cadre de dialogue ouvert entre régulateurs et professionnels sur les thèmes évoqués.

#### TEXTES DE REFERENCE

Amendement à l'accord sur les fonds propres pour son extension aux risques de marché ("Bâle I" - 1996)

International Convergence of Capital Measurement and Capital Standard ("Bâle II" - 2005)

International Convergence of Capital Measurement and Capital Standards (résultats de QIS 3 - Octobre 2009)

#### INTERVENANTS :

- **C.K. Tran, responsable - E. Guilly - P. Durand - C. Françoise**, Membres de la cellule de Contrôle des Risques Modélisés (CCRM)/Inspection Banque de France/Secrétariat Général Commission Bancaire,
- **Nathalie Bouez, BNP Paribas** co-responsable de « Risk Architecture » au sein de « Risk Capital Markets/Group Risk Management »
- **Pascal Gibart, CALYON** Responsable des Méthodologies, Direction des risques
- **Olivier Prato**, Chef du Service des Affaires Internationales, Direction de la Surveillance, Secrétariat Général Commission Bancaire - **Nicole El-Karoui**, Professeur des Universités, UPMC & CNAP

**Coût de la formation :** 600

*Pris en charge dans le cadre de la réglementation de la formation continue*

☐ Télécharger le programme détaillé

- Programme de la formation

Pour plus d'information: [contact@eifr.eu](mailto:contact@eifr.eu)