

## BÂLE III : BACKTESTING

### PROGRAMME

- INTRODUCTION
  - Rappels du cadre réglementaire
  - Définition du backtesting
- BACKTESTING DES CALCULS DE RISQUE DE MARCHÉ
  - Présentation de la problématique
  - Exigences réglementaires
  - Approches complémentaires
  - Dispositif global (de la mise en place des calculs aux reportings à destination des autorités)
  - Suivi des résultats du backtesting  
*Cas pratique. Backtesting VaR Marché*
- BACKTESTING DU RISQUE DE CRÉDIT ET DE CONTREPARTIE
  - Présentation de la problématique
  - Exigences réglementaires
  - Backtesting des ratings/PD/LGD
  - Backtesting des EAD
  - Dispositif global (de la mise en place des calculs aux reportings à destination des autorités)
  - Suivi des résultats du backtesting  
*Cas pratique. Backtesting des simulations des prix de marché*
- CONCLUSION ET DISCUSSIONS

### DESCRIPTION

Les normes réglementaires mettent un accent particulier sur les mesures d'audit et de vérification des processus de gestion des risques. Depuis la crise financière de 2008, les réglementations et les autorités prudentielles exigent encore davantage de rigueur et d'attention dans la mise en place de ces mesures. Parmi elles figure le processus de backtesting. Le backtesting consiste à vérifier à posteriori les capacités de prédiction d'un modèle ou d'un dispositif de simulation. Dans le cadre Bâle III les normes concernant le backtesting ont été renforcées et plus particulièrement en ce qui concerne le backtesting du modèle interne de risque de contrepartie.

### OBJECTIFS

- Comprendre le concept de Backtesting
- Se familiariser avec les différentes applications du backtesting dans le cadre réglementaire (Bâle III)
- Appréhender les méthodes de backtesting et leurs avantages et limites

### PUBLIC

- Gestionnaires de risque
- Analystes RWA
- Audit interne
- Informaticiens financiers
- Chefs de projet MOA

### NIVEAU

Avancé

### PRÉ-REQUIS

- Solides notions de finance et de gestion des risques
- Notions de base des dispositifs réglementaires

### FORMATIONS ASSOCIÉES

- PREPAREZ-VOUS
  - De Bâle 2 IRBA vers Bâle 3 : Nouvelles exigences en fonds propres
  - Bâle III : Risque réglementaire

### FORMATEUR

Saïd Mohajeri

### DURÉE

1 jour

### FORMAT

journée/soirée

### PRIX

1 150 € HT