

BÂLE III : STRESS-TESTING

PROGRAMME

- INTRODUCTION
 - Rappels du cadre réglementaire
 - Définition du calcul stressé
- PRÉSENTATION GLOBALE DES CALCULS STRESSÉS
 - Différents types de calcul
 - Mise en œuvre
- CONTRAINTES DES CALCULS STRESSÉS
- PRINCIPAUX TYPES DE STRESS-TESTS
 - Analyse de sensibilité
 - Analyse de scénarios
 - Reverse stress-tests
- GRANULARITÉ DES STRESS-TESTS
- UTILISATION DES STRESS TESTS
 - ICAAP
 - Outil d'appréciation du régulateur
 - Gestion des risques
- RISQUE DE MARCHÉ
 - VaR stressée (calibration, impact réglementaire)
 - Stress-tests de la VaR
 - Dispositif de reporting
- CALCULS STRESSÉS DANS LE CADRE DU RISQUE DE CONTREPARTIE
 - EEPE stressée
 - CVA capital charge stressé
 - Stress-tests des expositions
- CALCULS STRESSÉS DU RISQUE DE CRÉDIT
- CALCULS COMBINÉS DU RISQUE DE CRÉDIT ET DE CONTREPARTIE : INTRODUCTION À LA WWR
- CONCLUSION ET DISCUSSIONS

DESCRIPTION

Les stress-tests consistent à évaluer le comportement d'un dispositif en cas de choc des variables d'entrée du système. Dans la réglementation Bâle III, un certain nombre de mesures sont prévues permettant de mesurer l'impact de conditions de marché stressées sur les différents calculs réglementaires. Les calculs stressés peuvent être des éléments d'information et d'analyse mais également intervenir directement dans la définition des montants de fonds propres réglementaires.

OBJECTIFS

- Comprendre le concept de calcul stressé
- Se familiariser avec les différentes applications des calculs stressés dans le cadre réglementaire (Bâle III)
- Appréhender les méthodes de stress-testing, 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
- ALLEZ PLUS LOIN
 - Bâle III : Backtesting

FORMATEUR

Saïd Mohajeri

DURÉE

1 jour

FORMAT

journée/soirée

PRIX

1 150 € HT