

●●● Fundamental Review of the Trading Book (FRTB)

Développer les outils de calculs et de supervision du risque pour une conformité avec FRTB

PUBLIC

Analystes Front office et services IT liés – Analystes risque et IT risque – Service conformité – Consultants en banque d'affaires

PRÉ-REQUIS

Avoir des notions de base sur la VaR est souhaitable ou un bagage quantitatif et une expérience en lien avec les marchés et produits financiers

NIVEAU D'EXPERTISE

Perfectionnement

MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.
- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
 - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service

Code
1866

Durée
2 jours / 14 heures

Tarif
Nous contacter

**Repas inclus (en présentiel)*

Objectifs pédagogiques

- Interpréter les frontières entre trading book et banking book
- Calculer les composantes de la FRTB
- Différencier le modèle interne du modèle standard
- Mesurer l'impact de la FRTB sur le niveau des Fonds Propres réglementaires
- Mobiliser les ressources techniques et informatiques en anticipation des impacts de la FRTB

Programme de la formation

Engagement

Vous vous engagez dans votre formation. Connectez-vous sur votre espace participant et complétez votre questionnaire préparatoire. Votre formateur recevra vos objectifs de progrès.

Régulations bancaires et gestion des risques

- Historique des régulations bâloises
- Crise financière des subprimes 2008
- Défaillance de la VaR comme mesure de risque de marché
- Introduction à une nouvelle réglementation

Distinctions entre trading book et banking book

- Définitions : banking book, trading book
- Frontières entre trading book et banking book
- Trading desk : définition, unité de reporting, unité de monitoring
- Périmètre de régulation : trading desk, entité globale, fréquences

Approche Standard : Sensitivities Based Method & RRAO

- Méthodologie de calcul : delta, vega, curvature, scénarios
- Périmètre : scope d'instruments, exceptions, spécificités
- GIRR : facteurs de risques, sensibilités, bucketing, risk weight, correlations
- Equity : facteurs de risques, sensibilités, bucketing, risk weight, correlations
- Other risk class : FX, commodities, credit spread

- ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

ACCOMPAGNEMENT FORMATION À DISTANCE

En cas de nécessité, une assistance technique et pédagogique est joignable entre 8h30 et 18h (jours ouvrés):

- par téléphone : 01 83 10 10 10
- par mail : care-formation@lefebvre-dalloz.fr

Une réponse immédiate est apportée ; si besoin, le demandeur est mis en relation avec un expert dans un délai maximum de 48h.

- Residual Risk Add On (RRAO)
- Workshop : calcul de la charge en capital pour GIRR & Equity

Approche Standard : Default Risk Capital

- Calcul de la charge en capital : jump to default, bucketing, hedge benefit ratio
- Périmètres : equity, credit, Non securitization, Sec CTP, Sec Non CTP
- Workshop : calcul du DRC-SA pour Non Sec, Sec CTP, Sec Non CTP

Eligibilité : facteurs de risques et modèle interne

- Eligibilité des facteurs de risques : définitions par classes de risques, critères d'éligibilité, RFET
- Backtesting : VaR, APL, HPL, Backtesting zones
- P&L Attribution : RTPL, HPL, Spearman correlation, Kolmogorov-Smirnov, tests metrics

Approche Modèle interne : Expected Shortfall & NMRF

- Transition Value at Risk vers Expected Shortfall
- Expected Shortfall (ES) : facteurs de risques modélisables, horizons de liquidité/observation, modèle de simulation, partial ES
- NMRF : facteurs de risques non modélisables, SES, calcul de la charge en capital
- Workshop : comparaison entre VaR et ES

Approche Modèle interne : Default Risk Capital

- Méthodologie : VaR Monte Carlo, Scénarios de défaut des émetteurs
- Défauts composites : baskets, fonds, indices
- P&L VaR : instruments crédit, instruments equity, instruments hybrides
- Workshop : calcul de DRC-IMA

Challenges d'implémentation

- Architecture fonctionnelle : suivi de limites & FRTB, réseau de systèmes complexes
- Ressources IT : systèmes big data, data quality, data certification, grilles de calculs
- Solutions logicielles pour calcul des métriques FRTB.

Transfert

Votre parcours de formation se poursuit dans votre espace participant. Connectez-vous pour accéder aux ressources et faciliter la mise en œuvre de vos engagements dans votre contexte professionnel.

A noter

...

En amont et en aval de la formation, le positionnement pédagogique sera effectué à l'aide d'un questionnaire d'auto-positionnement.