

# ÉVALUATION ET CONTRÔLE DU RISQUE DE CREDIT (SÉMINAIRE CONJOINT AVEC LE FEDERAL RESERVE BOARD)

14 – 18 SEPTEMBRE 2015

## Objectif

Ce séminaire vise à :

- approfondir les compétences en matière de contrôle du risque de crédit des participants,
- donner une vue pratique du contrôle du risque de crédit à partir d'études de cas,
- se familiariser avec les techniques de contrôle,
- être capable d'évaluer un profil des risques et d'identifier les outils de supervision adéquats.

## Participants

Ce séminaire pratique s'adresse aux superviseurs bancaires ayant déjà une expérience dans le domaine de l'analyse des banques, tant sur place que sur pièces.

## Contenu

Les thèmes suivants seront abordés et feront l'objet d'étude de cas :

- Définition du risque de crédit
- Règles Bâloises relatives au risque de crédit
- Risk management du risque de crédit (incluant RAROC et gestion du portefeuille),
- Le contrôle sur pièce du risque de crédit,
- Le contrôle sur place du risque de crédit,
- Système de notation (conception et validation),
- PD, LGD, EAD,
- Stress testing,
- Mise en œuvre par les banques et validations des systèmes avancés.

Une table ronde sera organisée afin de permettre des échanges d'informations et d'expériences entre les participants, notamment au travers de courtes présentations de leur problématique nationale.

## Durée

5 jours : 14 – 18 septembre 2015

## Date limite d'inscription

10 juillet 2015

## Langue

Anglais et Français avec traduction simultanée

## Lieu

Paris

## Responsable du séminaire

Jean-Luc QUEMARD

## Adresse de contact

[creditrisk15@banque-france.fr](mailto:creditrisk15@banque-france.fr)

## Inscription en ligne

<https://www.banque-france.fr/eurosysteme-et-international/ibfi-institut-bancaire-et-financier-international/informations-pratiques/fiche-dinscription.html>