



INSTITUT BANCAIRE ET FINANCIER INTERNATIONAL
INTERNATIONAL BANKING AND FINANCE INSTITUTE

SEMINAIRE

GESTION DES RISQUES FINANCIERS DANS UNE BANQUE CENTRALE

PARIS 19 - 21 MARS 2018

ESPACE CONFERENCE SALLE 2

PROGRAMME



LUNDI 19 MARS

8h45	Rendez-vous au siège de la Banque de France – Espace Conférences, salle 2 31 rue Croix des Petits Champs, 75001 Paris, avec Yasmina SAFY
9h00	Présentation des participants et propos préliminaires Yasmina SAFY Responsable de l'Institut Bancaire et Financier International
9h45	Organisation de la gestion et gouvernance des risques à la BdF Philippe MONGARS Directeur des Risques et de la Conformité des Opérations
10h30	Photo de groupe et pause-café
10h45	Analyse des risques de marché : risque de change et implications pour la stabilité financière Pierre-Yves GAUTHIER Adjoint au chef du Service Évaluation des Risques et Vulnérabilités Financières Direction de la Stabilité Financière
12h15	Déjeuner
14h15	Étude de cas, exercice sur le risque de change Pierre-Yves GAUTHIER
15h00	VaR de marché <ul style="list-style-type: none">. méthodologies de calcul. limites.exercice, étude de cas Sébastien GALAIS Analyste Risque de Marché Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
16h00	Pause-café
16H15	La gestion des risques des opérations de politique monétaire Benoit USCIATI (Adjoint au chef du service) et Matthieu MILAN Service de Valorisation Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
17h30	Fin de la session
17h45	Tour de Paris en car
19h00	Diner
21h30	Retour en car à la Banque de France

MARDI 20 MARS

9h00	Calcul et attribution de performance Marie-Hélène DUMENIL Analyste Risque de marché Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
10h00	Pause-café
10h15	Calcul et attribution de performance : exercice, étude de cas Marie-Hélène DUMENIL
11h15	Système interne d'évaluation du crédit IRATE François BOUVET et Astrid LABOURET Chef du pôle Encadrement des risques et Analyste Risque de Marché Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
12h15	Déjeuner
14h30	Valorisation des actifs financiers . Valorisation du collatéral de politique monétaire: rappel des principes . Une plateforme unique pour valoriser le collatéral : CEPH Objectifs de la plateforme Processus de valorisation : description de la démarche Cédric JACQUAT Chef du Service de Valorisation Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
15h30	Risque de crédit (calcul de VAR) Olivier TOUTAIN Chef du pôle Modélisation Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit Direction des Risques et de la Conformité des Opérations
16h15	Pause-café
16h30	Risque de crédit (suite) Olivier TOUTAIN
17h30	Fin de la session

9h30

La gestion actif-passif à la BdF

Claire de CREVOISIER
Chef du Service de Gestion Financière
Direction de la Stabilité Financière

10h45

Pause-café

11h00

Wrap-up: session de questions et réponses

Marc BARAN
Adjoint au Directeur des Risques et de la Conformité des Opérations

11h30

Conclusion, évaluation du séminaire

Yasmina SAFY
Marchés et Opérations
Institut Bancaire et Financier International

12h00

Déjeuner buffet

12h30

Fin du séminaire