



INSTITUT BANCAIRE ET FINANCIER INTERNATIONAL
INTERNATIONAL BANKING AND FINANCE INSTITUTE

PROGRAMME

GESTION DES RISQUES FINANCIERS DANS UNE BANQUE CENTRALE

PARIS 24 - 27 FÉVRIER 2020

ESPACE CONFÉRENCE SALLE 2



LUNDI 24 FÉVRIER

8h45 Rendez-vous au siège de la Banque de France – Espace Conférences, salle 2
31 rue Croix des Petits Champs, 75001 Paris.

9h00 **Présentation des participants et propos préliminaires**
Résultats du questionnaire

Yasmina SAFY
Marchés et Opérations
Institut Bancaire et Financier International

9h45 **Organisation de la gestion et gouvernance des risques à la Banque de France**

Jean-Michel BOUCARUT
Directeur des Risques et de la Conformité des Opérations

10h30 Photo de groupe et pause-café

11h00 **Les différents types de risques financiers**

Claire de CREVOISIER – Arthur DIVISIA
Chef de service et Adjoint du Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

12h15 Déjeuner

13h45 **Analyse des risques de marché : risque de change et implications pour la stabilité financière**

Pierre-Yves GAUTHIER
Chef du Service Évaluation des Risques et Vulnérabilités Financières
Direction de la Stabilité Financière

15h00 Pause-café

15h15 **Exercice sur le risque de change**

Pierre-Yves GAUTHIER

17h30 Fin de la session

17h45

19h30

21h45

MARDI 25 FÉVRIER

8h45 Rendez-vous au siège de la Banque de France – Espace Conférences, salle 2
31 rue Croix des Petits Champs, 75001 Paris.

9h00 **VaR de marché**

Thomas DIEU
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

10h30 **Le cadre de contrôle des risques des opérations de politique monétaire**

Hélène CHARASSON-JASSON
Service d'Analyse des Risques et Valorisation Eurosysteme (SARV)
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

12h15 Déjeuner

14h00 **Calcul et attribution de performance**

Maeva SILVESTRINI
Analyste Risque de marché
Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

15h00 Pause-café

15h15 **Étude de cas : risque et performance**

Maeva SILVESTRINI et Thomas DIEU
Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

16h30 **Échange d'expérience**

Banque Nationale de Bulgarie

17h00 Fin de la session

MERCREDI 26 FÉVRIER

9h15 Rendez-vous au siège de la Banque de France – Espace Conférences, salle 2
31 rue Croix des Petits Champs, 75001 Paris.

9h30 **Système interne d'évaluation du crédit IRATE**
Delphine BRAUN et Emmanuelle BIERRE
Analyste Risque de Crédit Senior et Analyste Risque de Marché Senior
Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

10h45 Pause-café

11h00 **Valorisation des actifs financiers**
. Valorisation du collatéral de politique monétaire: rappel des principes
. Une plateforme unique pour valoriser le collatéral : CEPH
Lara CORMEIL et Louis OLIVE
Service d'Analyse des Risques et Valorisation Eurosysteme (SARV)
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

12h15 Déjeuner au restaurant « Baltard au Louvre »

14h00 **Risque de crédit (calcul de VAR)**
Adrien BECAM
Service de Gestion des Risques de Marché et de Crédit
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

15h30 **Échange d'expérience**
Banque centrale du Népal

16h00 Pause-café

16h30 Visite de la Galerie Dorée

17h00 Fin de la session

JEUDI 27 FÉVRIER

9h15 Rendez-vous au siège de la Banque de France – Espace Conférences, salle 2
31 rue Croix des Petits Champs, 75001 Paris.

9h30 **La gestion actif-passif à la BdF**

Valérie DUMAS
Chef du Service de Gestion Financière
Direction Financière et du Contrôle de Gestion

10h30 Pause-café

11h00 **Session de clôture**

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

11h30 Évaluation du séminaire

Yasmina SAFY
Marchés et Opérations
Institut Bancaire et Financier International

12h00 Déjeuner

13h00 Fin de la session