

CERTIFICAT D'EXPERTISE EN TRAITEMENT PRUDENTIEL BÂLE III ET SA FINALISATION

AFGES

2 CALENDRIER ET TARIFS 2020

Réf.	Titre	Prix HT catalogue	Nbre jours	Dates
300	Bâle III (CRR, CRR2, CRDIV, CRDV) : l'essentiel	844 €	1	23 mars 2020 10 juin 2020 17 septembre 2020 25 novembre 2020
303	Bâle III (CRR/CRR, CRDIV, CRDV) : fonds propres et ratio de levier	844 €	1	11 juin 2020 26 novembre 2020
304	Bâle III (CRR, CRR2, CRDIV, CRDV) : fondamentaux du risque de crédit	1630 €	2	15 au 16 juin 2020 30 nov. au 1 ^{er} déc. 2020
429	Mesure et gestion des risques opérationnels	1630 €	2	22 au 23 juin 2020 7 au 8 décembre 2020
423	Mesure et gestion du risque de marché	2 247 €	3	17 au 19 juin 2020 2 au 4 décembre 2020
425	Mesure et gestion du risque de liquidité (LCR, NSFR, ALMM)	844 €	1	12 juin 2020 27 novembre 2020
426	Mesure et gestion du risque de contrepartie et des différents ajustements de valeurs XVA	844 €	1	30 juin 2020 15 décembre 2020
427	Mesure et gestion de l'IRRBB (risque de taux dans le portefeuille bancaire)	600 €	0,5	24 juin 2020 9 décembre 2020
428	Risque de concentration, large Exposures (grands risques)	600 €	0,5	24 juin 2020 9 décembre 2020
305	Bâle III, pilier 2 (Srep, Raf, Stress test, ICAAP, ILAAP)	1630 €	2	25 au 26 juin 2020 10 au 11 décembre 2020
309	Dispositifs et ratios de résolution bancaire TLAC, MREL	844 €	1	29 juin 2020 14 décembre 2020
307	Bâle III et sa finalisation Synthèse des principales mesures	844 €	1	1 ^{er} juillet 2020 16 décembre 2020
325	Préparation examen	844 €	1	2 juillet 2020 17 décembre 2020
326	Oral	500 €	30 mn	3 juillet 2020 18 décembre 2020

- ◆ Cycle complet de 18 jours y compris l'examen : 10 630 € HT.

3 PROGRAMME DÉTAILLÉ

1 Bâle III l'essentiel (1 jour)

- ◆ Environnement.
- ◆ Pilier 1 : les ratios.
- ◆ Pilier 2.
- ◆ Pilier 3 : informations financières sur la gestion des risques.

2 Fonds propres Bâle III et ratio de levier (incluant la finalisation Bâle III) (1 jour)

- ◆ Bases comptables : synthèse IFRS.
- ◆ Composantes des fonds propres.
- ◆ ratios minimums et Coussins de fonds propres.
- ◆ Ratio de levier.
- ◆ Mise en oeuvre des exigences en fonds propres, contraintes et gouvernance internationale.

3 Fondamentaux du risque de crédit (incluant la finalisation Bâle III) (2 jours)

- ◆ Introduction.
- ◆ Mesure du Risque de crédit : calcul de RWA en approche standard (Notation Externe).
- ◆ Mesure du Risque de crédit : calcul de RWA en approche IRB (notation interne).
- ◆ Focus défaut, Forbearance, performing / non performing exposure (P/E/N.P.E).
- ◆ Focus titrisation.
- ◆ Les reportings.
- ◆ Les réformes de finalisation de Bâle III.
- ◆ Autres réglementations impactant la gestion du risque de crédit.

4 Mesure et gestion du risque opérationnel (incluant la finalisation Bâle III) (2 jours)

- ◆ Introduction.
- ◆ Savoir gérer le risque opérationnel.
- ◆ Savoir réaliser une cartographie des risques opérationnels.
- ◆ Risque opérationnel et conformité.
- ◆ Spécificité de la gestion de la fraude.
- ◆ Spécificité du risque informatique et des enjeux de cyber sécurité.
- ◆ Spécificité des enjeux de l'externalisation.
- ◆ Risque opérationnel et calcul des fonds propres.

5 Mesure et gestion du risque de marché (incluant la finalisation Bâle III) (3 jours)

- ◆ Introduction.
- ◆ Mise en œuvre d'un dispositif de gestion du risque de marché.
- ◆ Typologie de risques de marché.
- ◆ Mesure du risque de marché en approche standard.
- ◆ Mesure du risque de marché en approche des modèles internes.
- ◆ Évolutions à VENIR: la "FUNDAMENTAL REVIEW of the Trading Book" (FRTB).

6 Mesure et gestion du risque de liquidité (1 jour)

- ◆ Introduction.
- ◆ Mesure du risque de liquidité.
- ◆ Focus gestion liquidité intraday.
- ◆ Le ratio de liquidité court terme (LCR).
- ◆ Le ratio structurel de liquidité long terme (NSFR).
- ◆ Les outils de suivi supplémentaires (modèle ALMM (Additional liquidity metrics monitoring).
- ◆ Le contingency funding plan.
- ◆ Le reporting.
- ◆ Lien avec le dispositif d'appétit aux risques et ILAAP.

7 Mesure et gestion du risque de contrepartie et les différents ajustements de valeurs XVA (incluant la finalisation Bâle III) (1 jour)

- ◆ Introduction.
- ◆ Approche prudentielle de calcul de l'exposition au risque de contrepartie.
- ◆ Prise en compte des ajustements de valeur XVA.
- ◆ Utilisation de chambres de compensation (ccp) pour réduire le risque de contrepartie.

- ◆ Dispositif opérationnel de gestion du risque de contrepartie.
- ◆ Les réformes de finalisation de Bâle III.
- ◆ Vue d'ensemble SUR LE RISQUE DE règlement/livraison (settlement/delivery risk).

8 Mesure et gestion de l'IRRBB (risque de taux dans le portefeuille bancaire) (0,5 jour)

- ◆ Introduction.
- ◆ Mesure du risque de taux.
- ◆ Gestion opérationnelle du risque de taux.
- ◆ Les attentes de la supervision bancaire sur la gestion de l'IRRBB.

9 Risque de concentration, large expositions (grands risques) (0,5 jour)

- ◆ Introduction.
- ◆ Calcul de l'exposition.
- ◆ Limite des grands risques.
- ◆ Évolutions réglementaires à venir CRR2.

10 Bâle III, pilier 2 (SREP, RAF, stress test, ICAAP, ILAAP) (2 jours)

- ◆ Introduction.
- ◆ SREP.
- ◆ l'ICAAP.
- ◆ l'ILAAP.
- ◆ Stress tests.
- ◆ RAF : dispositif d'appétit aux risques.
- ◆ Plans de rétablissement bancaires.
- ◆ Reporting STE (Short Term Exercise) dans le cadre du SREP.

11 Dispositifs et ratios de résolution bancaire TLAC, MREL (0,5 jour)

- ◆ Dispositif de supervision autour de la résolution bancaire.
- ◆ Fonds de résolution.
- ◆ Mécanisme de Bail-in.
- ◆ Le ratio TLAC (Total Loss Absorbing capacity).
- ◆ Le ratio MREL (Minimum Requirement for own funds and Eligible Liabilities).
- ◆ Analyse comparative entre le TLAC et le MREL.
- ◆ Focus sur les typologies de dettes subordonnées éligibles (Coco BONDS, NPS (Non preferred SENIOR Debt,...)).
- ◆ Reporting.
- ◆ Plans de résolution bancaires.

12 Synthèse finalisation Bâle III (0,5 jour)

- ◆ Les grandes mesures de finalisation de Bâle III.
- ◆ Projets de CRR2, CRD5, BRRD1, BRRD2, CRR3.
- ◆ Calendrier de déploiement.
- ◆ Enjeu de mise en œuvre au sein des banques.

13 Préparation examen (1 jour)

14 Soutenance (1 heure)

CERTIFICAT D'EXPERTISE EN TRAITEMENT PRUDENTIEL BÂLE III ET SA FINALISATION

AFGES

1 OBJECTIF DU PARCOURS/CERTIFICAT

- ◆ Certifier la compétence en réglementation Bâle III des professionnels de toutes les fonctions bancaires impactées par la réglementation prudentielle.
- ◆ Faciliter la compréhension du risk management, de la réglementation prudentielle Bâle III et de son lien avec l'approche normative comptable.
- ◆ Fournir les clés permettant de déployer opérationnellement la réglementation prudentielle au sein des établissements.
- ◆ Préparer les opérationnels aux différents changements réglementaires à venir.

1.1 Qui peut présenter cet examen ?

- ◆ Fonctions de contrôle (Middle et Back Office).
- ◆ Risk Management.
- ◆ Reporting financier et réglementaire.
- ◆ Audit et inspection (interne et externe).
- ◆ Services comptables et financiers).
- ◆ Communication financière.
- ◆ Superviseurs externes.
- ◆ Fonctions de direction.

1.2 Validation du certificat

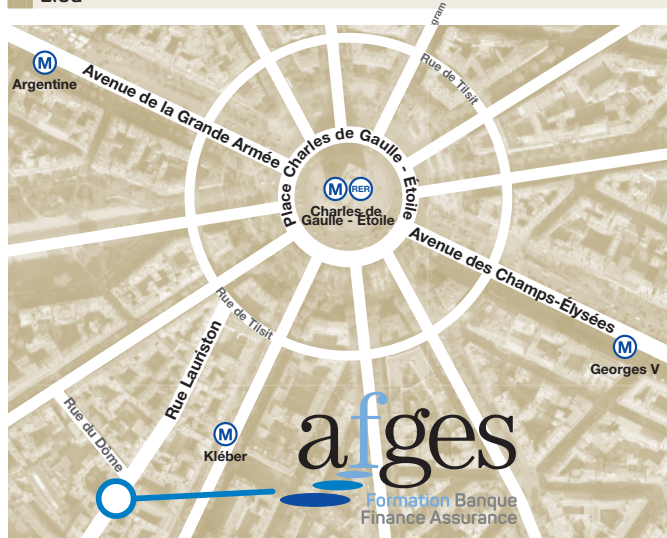
- ◆ Soutenance orale.

CERTIFICAT D'EXPERTISE EN TRAITEMENT PRUDENTIEL BÂLE III ET SA FINALISATION

AFGES

INFORMATIONS PRATIQUES

Lieu



Afges

29 rue Lauriston - 75116 Paris
Tél. : 01 70 61 48 60
Email : contact@afges.com

Horaires

9 h 00 / 12 h 30 - Pause déjeuner - 14 h 00 / 17 h 30.

Contact

◆ Karim Sbai
Tél. : 01 70 61 48 66
Email : sbai@afges.com

CERTIFICAT D'EXPERTISE EN TRAITEMENT PRUDENTIEL BÂLE III ET SA FINALISATION

afges
Formation Banque
Finance Assurance

