



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, avec **Yasmina SAFY**

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 au restaurant « »

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 Tour de Paris en car

19h30 Dîner au restaurant « »

21h45 Retour en car à la Banque de France (optionnel)

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, avec **Yasmina SAFY**

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**

XXX
Service de Valorisation
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

12h15 Déjeuner au restaurant « »

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 centrale participante

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, avec **Yasmina SAFY** et **Dorian MOREAU**

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 de Valorisation
Direction des Risques et de la Conformité des Opérations

12h15 Déjeuner au restaurant « »

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 participante

16h00 Pause-café

16h30 **Échange d'expérience**
Banque centrale participante

17h15 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, avec **Yasmina SAFY**

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 buffet dans l'Espace Conférences

13h00 Fin de la session