



Formation Finalisation de Bâle III : nouvelles exigences en fonds propres

Durée : 7 heures

Certification : BTS Banque

Prix : 1100

Référence : 2101468

Catégorie	Comptabilité et Gestion
Sous-catégorie	Banque Finance Assurance
Pour qui ?	Toutes les personnes souhaitant connaître les évolutions réglementaires liées à la finalisation du dispositif Bâle III.
Prérequis	Connaissance de la réglementation Bâle II.
Objectifs pédagogiques	Comprendre les enjeux de la nouvelle réglementation issue de Bâle III. Identifier les changements essentiels des normes réglementaires. Déterminer l'impact de la réforme sur les exigences en fonds propres. Maîtriser les différentes approches au calcul des fonds propres.
Contenu de la formation	Appréhender les nouvelles exigences en fonds propres Un rappel sur le cadre réglementaire Bâle II. La crise financières et les réformes "Bâle 2.5". Les réformes "finalisation Bâle III" dans la logique de l'évolution réglementaire.

	<p>La réforme "finalisation Bâle III" : objectifs, périmètres réglementaires impactés, calendrier de l'implémentation.</p> <p>Exercice</p> <p>Identifier les dispositifs réglementaires impactés par la réforme.</p> <p>Comprendre le capital réglementaire</p> <p>La qualité des fonds propres : Tier 1, Tier 2, CET.</p> <p>La suffisance de fonds propres et les processus ICAAP, ILAAP.</p> <p>Les coussins de fonds propres.</p> <p>Nouveaux ratios de fonds propres : TLAC et Minimum Requirement for own funds and Eligible Liabilities (MREL).</p> <p>Les exigences renforcées pour les banques G-SIB.</p> <p>Travaux pratiques</p> <p>Déterminer la différence entre les fonds propres T1 et T2.</p> <p>Identifier les exigences en fonds propres</p> <p>Le concept de Capital Floor : contraintes sur les modèles internes.</p> <p>Les fonds propres pour le risque de crédit : risque de contrepartie (SA-CCR).</p> <p>La revue des pondérations pour le calcul des RWA en approches standardisées et IRB.</p> <p>Le traitement prudentiel des positions de titrisation.</p> <p>Le risque de marché : la revue fondamentale du portefeuille de négociation (FRTB).</p> <p>La nouvelle approche standardisée et révision de l'approche des modèles internes (IMA).</p> <p>La charge en fonds propres au titre de la variation de CVA : les approches BA-CVA et FRTB SA-CVA.</p> <p>Le risque opérationnel : approche standardisée (SMA) et suppression de la méthode des modèles internes.</p> <p>Travaux pratiques</p> <p>Comparer le risque de contrepartie avec la méthode CEM, le risque de marché avec le dispositif actuel, la charge en fonds propres avec le dispositif actuel CVA Risk Charge.</p>
--	---

	<p>Définir le risque de taux d'intérêt dans le portefeuille bancaire (IRRBB)</p> <p>Les concepts liés au risque de taux dans le portefeuille bancaire.</p> <p>Les exigences réglementaires Bâle III.</p> <p>Travaux pratiques</p> <p>Etudier le risque de taux dans le portefeuille bancaire dans ICAAP.</p>
Suite de parcours possible	<p>Trader - Front office</p> <p>Risk manager / Ingénieur risques</p>
Éligible au CPF	

FINANCEMENTS

OPCO
OPCA
FAF
Pôle Emploi
La Région



CONTACTS



IFFP - Tour Belvédère SPACES
1 Cours Valmy 92 800 Puteaux



01 80 88 44 55



administration@iffp.pro