

Module	Cible	Réglementation Bâloise
Socle commun	Centrales Cadres du secteur bancaire (Spécialistes en gestion de risques/Non spécialistes) ; Agents de Banques Centrales	Etape de l'homologation
Socle commun	Centrales Cadres du secteur bancaire (Spécialistes en gestion de risques/Non spécialistes) ; Agents de Banques Centrales	Chantier à mettre en œuvre dans le cadre du projet d'homologation
Socle commun	Centrales Cadres du secteur bancaire (Spécialistes en gestion de risques/Non spécialistes) ; Agents de Banques Centrales	Travaux à réaliser et résultats attendus pour l'homologation
Socle commun	Centrales Cadres du secteur bancaire (Spécialistes en gestion de risques/Non spécialistes) ; Agents de Banques Centrales	Conséquences sur l'organisation de la banque et ses différentes fonctions
Socle commun	Centrales Cadres du secteur bancaire (Spécialistes en gestion de risques/Non spécialistes) ; Agents de Banques Centrales	Intégration dans les processus de gestion (Use test)

Contenu du module « Spécialisation »

Module	Cible	Spécialisation / Zoom spécifique
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Impact de la réglementation sur la stratégie des banques
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Analyse financière d'une institution bancaire
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Analyse de la solvabilité
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Analyse de la qualité des actifs
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Analyses de la rentabilité
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Analyse de la liquidité
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur le ratio de liquidité LCR & NSFR

Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur la détermination des Risques pondérés dans la méthode Standard
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur la prise en compte des mécanismes d'atténuation du risque de crédit
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur la modélisation <ul style="list-style-type: none"> - Définition des modèles - Contraintes réglementaires dans la construction et l'utilisation des modèles (Explicabilité, Auditabilité, Traçabilité/reproductibilité, Stabilité, Appropriation par le management) - Modalité de construction des modèles <ul style="list-style-type: none"> o Principes de la démarche de modélisation statistique et économétrique o Approche de modélisation utilisées dans l'industrie <ul style="list-style-type: none"> ▪ Approches de modélisation de la Probabilité de défaut (PD) ▪ Approches de modélisation de la Perte en cas de défaut (LGD) ▪ Approches de modélisation du Credit Conversion Factor (CCF) ▪ Approche de d'estimation de l'exposition au moment du défaut (EAD) o Processus de validation des modèles o Limites des modèles - Backtesting des modèles - Recalibrage des modèles - Pré requis pour la mise en place de modèles <ul style="list-style-type: none"> o Constitution des historiques o Infrastructures informatiques o Compétences / Ressources nécessaires à la construction et au maintien des modèles - Mise en production des modèles - Introduction à la gestion du risque de modèle - Gouvernance des modèles - Études de cas sur les différentes approches
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur les reporting réglementaires
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur la définition des fonds propres
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Zoom sur le Risk management et le contrôle interne

Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Stress Test et ICAAP
Spécialisation	Spécialistes en gestion de risques ; Agents de Banques Centrales	Communication financière autour de la réglementation (Analyse des rapports des Etablissements avec un zoom sur le Pilier 3)