BANQUE - ASSURANCE

FRTB Fundamental Review of the Trading Book : cadrer, calculer et piloter

La revue fondamentale du portefeuille de négociation redéfinit la frontière entre portefeuille bancaire et portefeuille de négociation remplace la mesure du risque de marché et impose une validation par desk. Les équipes risques et finance doivent produire des sensibilités fiables documenter chaque facteur de risque et expliquer des exigences de fonds propres instables. Cette formation de 14 heures reconstitue la logique du dispositif : périmètre et gouvernance approche standard fondée sur les sensibilités approche par modèles internes avec ses tests de validation puis conduite du chantier. Les calculs sont illustrés sur un portefeuille simplifié travaillé du début à la fin.

DURÉE	MODALITÉ	TARIF	DÉLAI D'ACCÈS
2 jours — 14 h	**Présentiel ou à distance**	**À partir de 1 880 € HT**	**11 jours ouvrés après validation du financement.**

Mon Pôle Formation est un organisme certifié Qualiopi. La certification qualité a été délivrée au titre de la catégorie d'action suivante : **ACTIONS DE FORMATION** — certificat n° 76 31 02622 31 (SGS ICS)

01 Public visé et prérequis

PUBLIC VISÉ
Analystes et contrôleurs des risques de marché collaborateurs de la finance et du reporting réglementaire auditeurs internes et équipes projet engagées dans la mise en œuvre du dispositif.

PRÉREQUIS
Connaître les instruments de marché et les principes du calcul des exigences de fonds propres.

POSITIONNEMENT À L'ENTRÉE
Analyse du besoin et test de positionnement. Vos réponses sont partagées avec votre formateur afin d'adapter la formation à votre niveau et votre contexte professionnel.

02 Objectifs pédagogiques

À l'issue de la formation, le participant sera capable de :

- Situer l'apport de la revue fondamentale par rapport au dispositif de risque de marché antérieur
- Délimiter la frontière entre portefeuille bancaire et portefeuille de négociation et encadrer les transferts
- Calculer une exigence en approche standard à partir des sensibilités d'un portefeuille
- Expliquer la logique de l'approche par modèles internes et ses tests de validation
- Identifier les données et les systèmes nécessaires à la production des calculs
- Anticiper les effets du dispositif sur le capital et sur l'activité des desks

03 Programme détaillé

M1 Genèse périmètre et gouvernance

- Où passe la frontière
- Limites du dispositif de risque de marché antérieur
- Critères d'affectation au portefeuille de négociation ou au portefeuille bancaire
- Encadrement des transferts entre portefeuilles et justification
- Définition du desk et rôle dans le dispositif
- Gouvernance documentation et responsabilités des fonctions concernées
- À retenir : L'affectation d'une position à un portefeuille n'est plus un choix de gestion libre mais une décision encadrée et documentée.

M2 Approche standard fondée sur les sensibilités

- Calculer sans modèle interne
- Décomposition du risque par classe et par facteur
- Mesures de sensibilité aux variations de premier et de second ordre
- Regroupement par compartiment et application des corrélations
- Exigence au titre du risque de défaut des positions de crédit
- Traitement des risques résiduels non couverts par la mesure principale
- Atelier : Calcul de l'exigence standard d'un portefeuille comportant des positions actions crédit et taux.

M3 Approche par modèles internes

- Mériter et conserver l'agrément
- Passage d'une mesure de valeur en risque à une mesure d'espérance de perte en queue
- Horizons de liquidité différenciés selon les facteurs de risque
- Distinction entre facteurs de risque modélisables et non modélisables
- Tests de validation par desk contrôle a posteriori et attribution du résultat
- Conséquences d'un échec aux tests et retour à l'approche standard
- Cas pratique : Analyse d'un desk en échec d'attribution du résultat et construction du plan de remédiation.

M4 Mise en œuvre données et pilotage

- Du calcul au programme de transformation
- Chaîne de données des systèmes front office jusqu'au reporting réglementaire
- Qualité des sensibilités et réconciliation avec le résultat comptable
- Organisation du reporting réglementaire et des contrôles associés
- Effets sur la consommation de capital et sur la tarification des activités
- Conduite du programme et articulation entre risques finance et informatique
- Mise en situation : Arbitrage entre approche standard et modèles internes pour un desk d'activité dont le volume est modéré.

04 Modalités pédagogiques, méthodes et moyens

MODALITÉS PÉDAGOGIQUES
Présentiel ou à distance

LIEU / FORMAT
Dans vos locaux — jusqu'à 10 collaborateurs, Paris — Présentiel, À distance — Classe virtuelle

MÉTHODES MOBILISÉES
• Apports théoriques, ateliers et cas pratiques. Support de cours numérique et fiches méthodes fournis.

ENCADREMENT
Formateurs qualifiés et expérimentés, experts de leur domaine, sélectionnés par Mon Pôle Formation.

05 Modalités d'évaluation et de suivi

ÉVALUATION DES ACQUIS
• QCM et mises en situation. Évaluation des acquis en début et en fin de parcours, évaluation à chaud et à froid à 60 jours.

SUIVI DE L'EXÉCUTION
• Émargement des participants
• Certificat de réalisation remis à l'issue de la formation

SANCTION DE LA FORMATION
Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

06 Type de reconnaissance

Formation non certifiante — Attestation de fin de formation et certificat de réalisation remis à chaque participant.

07 Modalités d'accès, financement et tarifs

MODALITÉS D'INSCRIPTION
Inscription en ligne, par téléphone, par devis ou via votre OPCO.

DÉLAI D'ACCÈS
11 jours ouvrés après validation du financement.

FINANCEMENTS POSSIBLES
• OPCO et plan de développement des compétences
• FAF et CFP
• France Travail
• Paiement jusqu'à 6 fois sans frais

DATES / SESSIONS
Entrées permanentes

FORMULE	DÉTAIL	TARIF
Inter-entreprises	-10 % dès 2 participants, -15 % dès 3, -20 % à partir de 4 inscrits sur la même session.	**À partir de 1 880 € HT**

Prix nets — exonération de TVA, article 261-4-4° du CGI.

08 Accessibilité aux personnes en situation de handicap

Accessible aux personnes en situation de handicap. Contactez notre référent handicap pour construire une solution adaptée : contact@monpoleformation.fr

RÉFÉRENT HANDICAP
Tiffany LESTROUBAC

CONTACT
contact@monpoleformation.fr

09 Indicateurs de résultats

INDICATEUR	RÉSULTAT	MODALITÉS DE CALCUL
Taux de satisfaction	**N/A**	Moyenne des notes de satisfaction des stagiaires sur les 12 derniers mois
Taux d'abandon	**N/A**	Calculé sur les 12 derniers mois

Résultats arrêtés au 29/09/2026. N/A : donnée non disponible ou effectif insuffisant sur la période.

10 Contacts

INSCRIPTIONS ET INFORMATIONS
contact@monpoleformation.fr
01 87 66 57 66

ADRESSE
10a rue du Maréchal de Lattre de Tassigny, 76420 Bihorel

RÉCLAMATIONS
Par e-mail : contact@monpoleformation.fr