

Conformité réglementaire

CADRAGE DU PROGRAMME FRTB SUR LES STREAM PROCESS ET DATA POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Étude globale des impacts FRTB sur les principales métriques : ES, PnL risk, SBA, RRAO, DRC
- Formalisation et analyse des processus et des outils existants : PnL, AR, VaR, Stress Tests, sVaR, Backtest, IRC/CRM et RWA
- Synthèse des axes d'amélioration des processus, de l'organisation, analyse des ruptures de chaîne
- Rédaction des expressions de besoins métier et formalisation des processus cibles de production de toutes les métriques FRTB
- Optimisation de factorisation avec les processus existants : risque, contrôle, analyse, certification et reporting au regard des exigences cibles

CADRAGE D'UN PROJET DE CALCUL DE LA CHARGE EN FONDS PROPRES LIÉ AUX ACTIVITÉS DE CLEARING DES DÉRIVÉS LISTÉS D'UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Définition et analyse de l'existant coté Securities Services : produits, systèmes et processus
- Identification des pistes de mutualisation des ressources et de standardisation des processus
- Définition d'un plan d'action pour l'implémentation de l'alimentation des données réglementaires des systèmes Risques
- Élaboration du référentiel méthodologique, spécifications du système cible

MISE EN PLACE D'UN MODÈLE DE NOTATION INTERNE BÂLE II POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Mise en place d'un modèle retail et corporate. Méthodes IRBA pour le retail et IRBF pour le corporate
- Rapprochement des données comptabilité / risques, vérification et analyse des paramètres bâlois (PD, EAD, LGD, RWA)
- Back testing et stress testing des paramètres de risques
- Réalisation de la recette et mise production des modèles

MISE EN PLACE DU DISPOSITIF DE GESTION DES DÉRIVÉS OTC DANS LE CADRE D'EMIR D'UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Recueil et analyse des besoins des utilisateurs, production des expressions de besoins
- Assistance des utilisateurs pour les phases d'homologation
- Rédaction et mise à jour des modes opératoires et du guide utilisateur, conduite du changement
- Formalisation d'avis d'expert sur les fonctions de compensation et de contrôle de l'activité
- Réalisation de la recette et mise en production des modèles