



ACTUARAT | GESTION DES RISQUES | SERVICES FINANCIERS

Paris, le 24 janvier 2022

## NEXIALOG CONSULTING ORGANISE UNE TABLE RONDE IRB REPAIR & RISQUES CLIMATIQUES

LE 10 FÉVRIER 2022 À 18H30, À L'HOTEL HILTON PARIS OPÉRA

Nexialog Consulting, cabinet de conseil spécialisé en **gestion des risques, actuariat et services financiers** auprès des **banques** et **assurances**, organise le 10 février prochain une conférence publique à l'hôtel Hilton Paris Opera, suivie d'un cocktail dînatoire.

Cette table ronde s'articulera autour de deux thématiques :

- La **réglementation IRB Repair**, la gestion de sa mise en application et des demandes du superviseur.
- Les **Risques Climatiques**, leurs impacts sur la gestion du risque et les activités de la banque.

Nos consultants experts et les intervenants débattront et répondront aux questions sur ces sujets.

Nos tables rondes s'articuleront autour de ces deux thématiques :

**La réglementation IRB Repair**, qui vise à encadrer l'utilisation des **modèles internes des banques** en approche IRB, a également pour but d'harmoniser les **pratiques de modélisation** afin de limiter la volatilité des fonds propres non directement liée au risque modélisé.

Bien que les principaux jalons théoriques d'implémentation soient désormais derrière nous, le contexte actuel et le retard qu'il a engendré dans la plupart des institutions financières, nous a amené à faire d'IRB REPAIR l'un des sujets de notre table ronde.

Nous aborderons les problématiques suivantes relatives au **risque de crédit** :

- Le superviseur demande une mesure d'écart avec les exigences IRB Repair. Quelles méthodes ont été retenues pour mesurer ces écarts ?
- Quelles approches pour la modélisation des Low Default Portfolio (LDP) ?
- Sous quels jalons intégrer la Nouvelle Définition du Défaut dans les modèles ? Comment gérer l'impact de la crise sanitaire sur les taux de défauts ?
- Quelle utilisation des modèles lorsque les marges sont élevées ?

### **Les Risques Climatiques.**

Les problématiques liées au climat suscitent un grand intérêt ces dernières années, du fait des conséquences déjà visibles des événements climatiques (inondations, sécheresses, ...) sur certaines régions du monde et des **évolutions réglementaires en faveur de l'intégration du risque climatique** dans le processus de gestion des risques bancaires.

Notre réflexion portera autour de 3 sujets liés à l'actualité sur ce thème :

- Comment répondre aux **exigences de la BCE** lors de l'exercice de Stress Test Climatique ?
- Comment gérer une demande des Commissaires aux Comptes de prendre en compte le risque climatique dans les provisions pour dépréciations des créances ?
- Comment prendre en compte le risque de transition ? Sur quels secteurs s'orienteront les investissements de demain ?

## INTERVENANTS

Nos intervenants sont **experts en risque de crédit et risques climatiques**.



## LA RÉGLEMENTATION IRB REPAIR



**LEILA  
HANI**

DIRECTRICE MODEL  
PERFORMANCE

BNP PARIBAS



**CECILE  
LE MOIGNE**

DIRECTRICE DE LA  
MODÉLISATION

GROUPE BPCE



**THOMAS  
DUPLANIL**

RESPONSABLE  
RISQUE DE CRÉDIT  
MODÈLES RETAIL

SOCIÉTÉ GÉNÉRALE



**STEPHANE  
GARNIK**

ASSOCIÉ - RISK  
MANAGEMENT & BANK

NEXIALOG  
CONSULTING



**FRANCOIS  
LATIERE**

ASSOCIÉ - RISK  
MANAGEMENT & BANK

NEXIALOG  
CONSULTING

## LES RISQUES CLIMATIQUES



**ARNAUD ROUX  
DE BEZIEUX**

DIRECTEUR DES  
RISQUES CLIMATIQUES

GROUPE BPCE



**PASCAL  
CARRÉ**

DIRECTEUR RISQUES  
MANAGEMENT GROUPE

CRÉDIT AGRICOLE  
CONSUMER FINANCE



**PIERRE  
CORRE**

CONSULTANT RISK  
MANAGEMENT & BANK

NEXIALOG  
CONSULTING

Les sujets de ces tables rondes sont donc au cœur des préoccupations actuelles des acteurs bancaires. N'hésitez pas à assister et à relayer médiatiquement cette première conférence publique 2022 de Nexialog Consulting.

**Christelle BONDOUX**

Associée Direction Commerciale et Recrutement  
cbondoux@nexialog.com  
06.99.30.42.49

**Paul-Antoine DELETOILLE**

Account manager - Risk Management & Bank  
padeletoille@nexialog.com  
07.64.57.86.59



**Hilton Paris Opéra**

108 Rue Saint-Lazare, 75008 Paris

**Métro** - Gare Saint Lazare, Saint

Augustin, Trinité d'Estienne d'Orves



**Judi 10 Février 2022**

18h30 - Accueil

18h45 - IRB Repair

19h45 - Risques Climatiques

20h30 - Cocktail Dînatoire