



## LE CONTEXTE

L'EBA, European Banking Authority, est l'autorité qui assure la réglementation et la surveillance prudentielle du secteur bancaire européen. Elle agit dans le cadre des textes législatifs comme CRR2 (Capital Requirements Regulation 2) pour superviser la mise en place de mesures réglementaires comme la **Fundamental Review of the Trading Book**, dispositif de suivi du risque de marché.

Dans ce cadre, l'EBA a lancé une consultation publique le 21 Novembre 2019 sur les exigences spécifiques en matière de reporting des risques de marché. La publication de ces Implementing Technical Standards constitue le premier pas vers la mise en place de la FRTB.



## LE CONTENU ET LES IMPACTS

21 Novembre 2019  
Ouverture de la consultation

7 Janvier 2020  
Clôture de la consultation

2<sup>e</sup> trimestre 2020  
Soumission du brouillon final

31 Mars 2021  
Production du 1<sup>er</sup> reporting

Phase d'implémentation ~1 an

### PRINCIPALES MESURES DE CETTE CONSULTATION

- Introduction de 2 templates de reporting:
  - **Sur les seuils** pour fournir des informations sur la **taille du trading book** et le **volume des activités** soumis au risque de marché.
  - **De synthèse des exigences en fonds propres** selon l'approche standard alternative (MKR-ASA).
- **Ce document de consultation est une première étape**, les exigences en matière de reporting sur le nouveau cadre de gestion des risques de marché seront progressivement étendues. **L'EBA adopte une approche graduelle**, les institutions restent soumises au dispositif actuel de gestion du risque de marché et aux obligations de déclaration associées.

### ENJEUX

- Collecte des données nécessaires
- Agrégation des données au niveau demandé (notamment de l'Article 94 CRR)
- Production automatisée des 2 templates à partir des données collectées
- Définition du processus de production sur la base d'une fréquence trimestrielle: définition d'un planning de production, identification des équipes en charge de la production, contrôle de la qualité des données en amont et en aval



## NOTRE INTERVENTION

Dans le cadre d'un programme FRTB, **Beam Advisory** vous propose son assistance sur plusieurs types de chantier, notamment :

### CHANTIER DATA MANAGEMENT

Recensement et collecte des données pour les nouveaux calculs, mise en qualité

### COORDINATION DU PROGRAMME / PMO

Animation workshops, suivi des plannings, mise en place de la gouvernance projet

### CHANTIER IMPACTS OPÉRATIONNELS

Définition et mise en place du processus de production des metrics et des reporting réglementaires associés



## ATOUS BEAM



Maîtrise des projets réglementaires, notamment FRTB mais aussi Bâle II, Bâle III, IFRS, STS, SFTR, ...



Coordination de projets et programmes complexes, notamment d'implémentation de data hub



Mise en qualité des données, évolutions et production des reporting réglementaires (e.g. MIF 2, EMIR, SFTR)



Connaissance de l'organisation interne des banques (et notamment des directions Finance & Risques)