

# Stress Tests

Ce séminaire a pour objectif de présenter les méthodologies utilisées par la Banque de France et l'Autorité de Contrôle Prudentiel et de Résolution (ACPR) pour développer et mettre en œuvre des tests de stress. Des experts de la direction de la stabilité financière présenteront les modèles de stress tests macroprudentiels développés par la Banque de France et leur utilisation pour la calibration du coussin contracyclique. Les représentants de l'ACPR présenteront les tests de stress top-down appliqués aux banques françaises.

## S'inscrire

Dates : 14-16 décembre

Dates limites d'inscription : 14 octobre

Langue: Anglais

Lieu: Paris

Contact: Hedi JEDDI

E-mail: [stresstest@banque-france.fr](mailto:stresstest@banque-france.fr)

## Contenu

Le séminaire portera sur les thèmes suivants :

- modèles de stress test macroprudentiels : modèles macroéconomiques empiriques, scénarios, contagion
- calibration du coussin contracyclique à l'aide de modèles de stress test macroprudentiels : modèles macroéconomiques structurels (DSGE)
- stress tests top-down appliqués aux banques françaises : scénarios, données et modèles
- outil de stress test utilisé par le Fonds Monétaire International pour les économies émergentes

## Participants

Ce séminaire est destiné aux experts travaillant dans les départements en charge de la stabilité financière, du contrôle bancaire, des études économiques et financières.