

# L'ACPR a présenté le nouveau cadre du Comité de Bâle pour le risque de marché lors d'une réunion de place organisée le 22 février

Le Comité de Bâle a publié le 14 janvier 2019 la version finalisée du nouveau cadre prudentiel pour le risque de marché. Ce standard, aussi appelé Revue Fondamentale du Portefeuille de Négociation (FRTB), avait été publié dans une première version en 2016.

En réponse à la crise financière de 2008, le Comité de Bâle a entrepris une profonde refonte du traitement prudentiel des risques de marché qui a abouti à la publication en 2016 d'un nouveau standard connu comme la Revue Fondamentale du Portefeuille de Négociation (*Fundamental Review of the Trading Book* – FRTB). La préparation de sa mise en œuvre a fait apparaître des difficultés d'application ainsi qu'un impact sur les exigences de fonds propres très largement supérieur aux objectifs initiaux. Lors de l'accord du 7 décembre 2017 sur la finalisation de Bâle III, le GHoS<sup>1</sup> a donc convenu de réviser le standard et d'en repousser la date de mise en œuvre de 2019 à 2022. Le 14 janvier 2019, le Comité de Bâle a publié la [version finalisée du standard](#), qui conserve les grands principes du standard de 2016 mais apporte les clarifications et le recalibrage nécessaires.

L'ACPR a présenté ce nouveau standard lors d'une réunion de place organisée le 22 février, qui a permis d'échanger sur les enjeux liés à sa mise en œuvre dans l'Union européenne.

---

<sup>1</sup> Le Groupe des Gouverneurs et des responsables du contrôle bancaire qui supervise le Comité de Bâle.