



Lettre

Titre	Mise à jour des instructions relatives à la grille d'autoévaluation du risque opérationnel pour les institutions utilisant l'AMA et l'approche standard
Category	Saines pratiques commerciales et financières
Date	12 avril 2017
Sector	Banques
Renvoi	Ligne directrice NFP pour les ID utilisant l'approche standard ou l'AMA

Destinataires : Institutions de dépôts utilisant l'approche standard ou l'AMA

Dans le cadre des processus d'approbation du Bureau du surintendant des institutions financières (BSIF) visant les demandeurs et les utilisateurs de l'approche standard et de l'approche de mesure avancée (AMA) pour modéliser le risque opérationnel, les institutions doivent remplir et soumettre une autoévaluation standard reposant sur les exigences minimales définies dans la ligne directrice A-1, Normes de fonds propres , et dans le document *Principles for the Sound Management of Operational Risk* publié par le Comité de Bâle sur le contrôle bancaire en 2011.

Le 29 juin 2016, le BSIF a publié la ligne directrice E-21, *Gestion du risque opérationnel* , dans laquelle il énonce ses attentes en matière de gestion du risque opérationnel. À l'appui de cette ligne directrice, le BSIF a créé une grille d'autoévaluation pour le risque opérationnel. Afin d'éviter le double emploi, le BSIF a révisé la grille d'autoévaluation du risque opérationnel pour les institutions utilisant l'AMA et l'approche standard afin d'en supprimer les critères qui figurent déjà dans la grille d'autoévaluation qui accompagne la ligne directrice E-21. Les demandeurs et les utilisateurs de l'approche standard et de l'AMA doivent maintenant remplir la grille d'autoévaluation qui accompagne la ligne directrice E-21 et la version révisée pour 2017 de la grille d'autoévaluation du risque opérationnel pour les institutions utilisant l'AMA et l'approche standard et ce, de façon continue comme l'exige le BSIF.

Si vous avez des questions, veuillez communiquer avec Denise.Price-Hoo@osfi-bsif.gc.ca.

Bob Hassan

Directeur général

Division de la gestion du risque opérationnel

Annexe – Grille d’autoévaluation du risque opérationnel pour les institutions utilisant l’AMA et l’approche standard (version révisée pour 2017)

La grille d’autoévaluation énonce les attentes à l’égard des exigences applicables aux demandeurs et aux utilisateurs de l’approche standard et de l’AMA sous l’ancre des critères minimaux définis dans la ligne directrice Normes de fonds propres du BSIF et dans le document *Principles for the Sound Management of Operational Risk* du Comité de Bâle sur le contrôle bancaire. La grille comporte deux feuilles de calcul : Pratiques de GRO et Méthodologie AMA. Voici des précisions au sujet de celles-ci :

En-tête de colonne	Définition	Options déroulantes
ID	Numéro de référence	
Critères	Articulation de l'exigence	
No de renvoi	Renvoi aux consignes réglementaires	
Renvoi SAP antérieur	Numérotation selon la grille d'évaluation du risque opérationnel de 2012 pour les institutions utilisant l'AMA et l'approche standard	
Note de conformité	La note indique le degré de conformité des institutions financières fédérales (IFF) aux critères du BSIF.	<ul style="list-style-type: none"> • S.O. • Pleine conformité • Conformité substantielle • Conformité partielle • Non-conformité
Date cible de conformité	Date prévue pour atteindre la pleine conformité ou date à laquelle elle a été atteinte.	
Vérification interne (stade de la vérification)	Vérification interne (Stade de la vérification) s'entend de la vérification / l'évaluation indépendante de la réponse des IFF aux critères du BSIF.	<ul style="list-style-type: none"> • S.O. • Travaux de vérification terminés • Travaux de vérification en cours • Aucun travail de vérification prévu

En-tête de colonne	Définition	Options déroulantes
Validation	Les réponses de validation témoignent de l'état d'avancement des travaux effectués par la fonction indépendante de validation de l'institution pour établir si le modèle de l'AMA est solide ou si des améliorations s'imposent. La validation doit comporter des éléments quantitatifs et qualitatifs et permettre d'évaluer la pertinence des processus de gestion des risques pour garantir que le cadre demeure pertinent.	<ul style="list-style-type: none"> • S.O. • Travaux de validation terminés • Travaux de validation en cours • Aucun travail de validation prévu
Commentaires, y compris les titres des documents à l'appui	Commentaires au sujet des faits probants et des documents à l'appui.	

Un tableau de concordance entre la grille d'autoévaluation du risque opérationnel de 2012 pour les institutions utilisant l'AMA et l'approche standard et la grille d'autoévaluation de la ligne directrice E-21 est disponible sur demande.