

Customer Risk Scoring (AML) : les pratiques conformes

Attentes de la FINMA, pratiques de marché, risk scoring dynamique

> Key risk indicators, data points, poids des risques...: qu'est-ce qu'un risk scoring compliant ?

> Risk scoring dynamique / "continu" : attentes de la FINMA, déficiences observées

> Intégrer le suivi des transactions et le scoring du risque

Marc Kilcher,

Associé, Regulatory & Compliance,
Financial Services,
KPMG Suisse, Genève

9.00 Identifier les facteurs de risque dans le KYC

- KYC: problématiques, attentes et qualité
- Exemples tirés de l'expérience d'audit
- Des key risk indicators (KRI) variés : caractéristiques du client et les produits et services offerts au client
- En général : différents KRI / quels data points sont des facteurs de risque qui peuvent être utiles pour la classification du risque ?
- Comment analyser les différents indicateurs ?
- Comment peut-on / doit-on mettre en oeuvre techniquement les indicateurs ?
- Quel poids attribuer aux différents indicateurs de risque ?
- Expérience de la pratique d'audit

Marc Kilcher

Hedi Radhouane,

Senior Manager,
KPMG Forensic, Genève

9.45 Les méthodes de Customer Risk Scoring : pratiques de marché

- Facteurs de risque, risk scoring et risk categorization (high, medium, standard)
- Benchmarking : comparaison des méthodes de risk scoring
- La classification des clients à risque standard en différentes sous-catégories dans le but de prioriser / optimiser la revue périodique : quels éléments du KYC utiliser ?

Marc Kilcher et Hedi Radhouane

Jha Madhumita,

Senior Manager,
Forensic & Integrity Services,
EY, Zurich

Jawad Hussein,

Senior Manager,
Forensic & Integrity Services,
EY, Zurich

10.30 Pause-café

10.50 Dynamic risk scoring; updating / refreshing the risk

- Observed deficiencies
- FINMA's expectations
- How can real-time monitoring achieve dynamic risk scoring?
- What role does data integration play in keeping risk scoring models current?
- How are behavioral analysis and machine learning used for timely updates to risk scores?
- What benefits come from scenario-based testing for dynamic risk scoring models?
- How do automated risk mitigation strategies contribute to AML risk management?
- Why is regular calibration essential for dynamic risk scoring models?
- Why is maintaining documentation and an audit trail crucial for dynamic risk scoring compliance?

Jha Madhumita and Jawad Hussein

11.25 Connecting Transaction Monitoring and Risk scoring

- How does integration connect transaction monitoring and risk scoring for comprehensive risk assessment?
- What is the role of correlated transactional patterns in identifying anomalies when connecting data with risk scoring results?
- How do threshold-based triggers dynamically adjust risk scores based on transactional thresholds?
- Why are adaptive machine learning models important for refining risk scores and adapting to emerging risks?
- How does the feedback loop between monitoring and scoring enhance overall risk assessment and detection capabilities?
- Why is real-time alerting in transaction monitoring critical for prompt investigation of flagged transactions?
- What benefits come from defining granular risk categories for transactions and assigning weights based on inherent risk?
- Why is transparent communication between transaction monitoring and risk scoring teams essential for effective collaboration and response to risks?

Jha Madhumita and Jawad Hussein

12.00 Fin du séminaire

Customer risk scoring (AML) : les pratiques conformes

Informations pratiques

Renseignements et inscriptions

par tél: +41 (0)22 849 01 11
 par fax: +41 (0)22 849 01 10
 par e-mail: info@academyfinance.ch
 par courrier: Academy & Finance SA,
 3 chemin de la marbrerie, CP 1344,
 CH-1227 Carouge
 www.academyfinance.ch

Lieu de la conférence

The Ritz Carlton Hôtel de la Paix
 11 quai du Mont-Blanc, Genève

Visio conférence

Le lien Zoom sera envoyé le 3 juin après-midi.

Prix

560 CHF (+ TVA 8.1%)
 Inscriptions supplémentaires de la même
 société: -50%

Inscription et paiement

Règlement par virement bancaire ou par carte de
 crédit. Le montant facturé sera débité dès récep-
 tion des informations relatives à la carte. Dans tous
 les cas, une facture vous sera transmise par email.

Annulation

Les annulations reçues avant le 24 mai 2024
 seront remboursées à hauteur de 100%. Les
 annulations reçues après le 24 mai ne seront
 pas remboursées. Pour être prise en compte,
 toute annulation doit être formulée par écrit
 (email, courrier ou télécopie) avant la conférence.
 Si l'annulation n'est pas reçue par courrier ou
 par fax avant la conférence, le montant total de
 l'inscription sera dû. Un remplacement est admis
 à tout moment. Il doit être communiqué par écrit
 avant la conférence.

Bulletin d'inscription

Je m'inscris à la conférence "Customer risk scoring (AML) : les pratiques conformes" à Genève le mardi 4 juin 2024.

Je participerai : en présentiel online (Zoom)

Pour plus de confort, inscrivez-vous par téléphone au +41 (0)22 849 01 11.

1^{ER} INSCRIT

Prénom et nom

Fonction.....

E-mail.....

2^{ÈME} INSCRIT (-50%)

Prénom et nom

Fonction.....

E-mail.....

Société.....

Adresse.....

Code postal..... Ville.....

Tél Fax.....

Nom et adresse email de la personne responsable du paiement de la facture

.....

Virement bancaire Mastercard VISA

N° de carte: ____/____/____/____ Date d'expiration: ____/____

Nom du détenteur de la carte

Date

Signature