ASSOCIATION EUROPE FINANCES RÉGULATIONS

INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT
Face to face

MODE DE PARTICIPATION
EIFR
Paris - 75002
Palais Brongniart, 28, place de la Bourse

DATE
01/24/2018

LIEU
Palais Brongniart, 28, place de la Bourse
Paris 75002

PARTICIPATION
€210

INSCRIPTION
www.aefr.eu

CONTACT
contact@aefr.eu
01 70 98 06 53

Workshop

Le pilotage du Passif des Fonds

La question de la dimension systémique des fonds reste pendante, bien qu'à l'évidence d'une nature radicalement différente de celles des banques. Il est toutefois clair que de ne pas connaitre la structure de son passif est une réelle contrainte pour ajuster au mieux son degré de liquidité, et gérer ce risque.

Une combinatoire de recherche académique, de nouvelles technologies et de la connaissance plus classique du fonctionnement de l'informatique des sociétés de gestion aboutit à une plateforme de modélisation de la gestion du passif des fonds, en s'appuyant sur quelques sociétés de gestion pilotes.

Cet atelier a pour objectif de partager les sous-jacents de l'analyse comportementale des investisseurs par typologie de clients ayant une cyclicité d'investissement et de désinvestissement distincts et mus par une aversion aux risques distincte, et les caractéristiques d'un outil de pilotage du passif en s'appuyant aussi sur des bases de données historiques de flux d'investissement / désinvestissement. Cet outil deviendra progressivement une plateforme à l'usage des sociétés de gestion.

Public Visé

- Société de gestion : Direction Générale, Directions de la gestion, des risques, du contrôle interne, de la recherche
- Securities services : fonctions Risques, Conformité
- Compagnies d'assurance : Direction des investissements
- Régulateurs
- Sociétés de conseil

OBJECTIFS PÉDAGOGIQUES

- Analyser les risques de liquidité d'un fonds et les attentes du régulateur
- Se familiariser avec la recherche académique sur la modélisation du comportement des clients d'un fonds
- Connaître les avancées méthodologiques et les nouveaux outils pour la gestion des risques de rachat
- Echanger avec les différents acteurs de la matière : sociétés de gestion, monde académique, conseil, éventuellement régulateur

PROGRAMME

8h30	**Introduction**
8h45	**La démarche de pilotage du passif : pourquoi ? comment ?**
9h15	**Les avancées de la recherche en matière d'analyse de comportements des investisseurs** Intervenants: Serge DAROLLES
9h55	**Les besoins et attentes des sociétés de gestion** Intervenants: Patrick MAURO Groupama AM
10h20	**Le projet MGPF (Modélisation de la Gestion du Passif des Fonds) : genèse, usages**
10h40	**Questions-réponses**
10h55	**Conclusion**