



ASSOCIATION
EUROPE
FINANCES
RÉGULATIONS

INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT

Face to face

MODE DE PARTICIPATION

Paris

Club CONFAIR : 54, rue
Laffitte - Paris 9e

DATE

Tuesday March, 27th
2012 from 8:30am to
10:00am

LIEU

Club CONFAIR : 54, rue
Laffitte - Paris 9e
Paris

PARTICIPATION

€0

INSCRIPTION

www.aefr.eu

CONTACT

contact@aefr.eu
01 70 98 06 53

Morning

EIFR's Morning meeting with Frederic ABERGEL and Laurent GRILLET-AUBERT "Market Imperfections and benefits from HFT: Limits and Issues"

en partenariat avec l'Institut Louis Bachelier

Programm

Intervenants :

M. Frédéric ABERGEL, Directeur du Laboratoire de Mathématiques appliquées aux systèmes, Directeur de la Chair de Finance quantitative, Ecole Centrale Paris

M. Laurent GRILLET-AUBERT, Economiste Senior, Division Etudes, Stratégies et Risques, Direction de la Régulation des Affaires Internationales, AMF

Des études récentes mettent en évidence des imperfections de marché à l'échelle du trading haute fréquence (THF). Par "imperfections", on entend ici un caractère de prédictibilité qui, si on l'utilise, permet de générer des profits sous la forme d'un arbitrage statistique. La connaissance de cette profitabilité est un point de départ incontournable pour l'évaluation de l'enjeu économique et sociétal du THF.

Frédéric ABERGEL et Laurent GRILLET-AUBERT se proposent d'aborder l'importance réelle et la légitimité d'une telle activité.

Contact : Audrey PARODIN au 01 49 27 13 78, ou contact@eifr.eu.