ASSOCIATION EUROPE FINANCES RÉGULATIONS

INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT
Face to face

MODE DE PARTICIPATION
Paris
Club Confair, 54, rue Laffitte, 75009 Paris

DATE
18th, January, 2013

LIEU
Club Confair, 54, rue Laffitte, 75009 Paris
Paris

PARTICIPATION
€0

INSCRIPTION
www.aefr.eu

CONTACT
contact@aefr.eu
01 70 98 06 53

Morning

«Gestion des risques comme source inexploitée de performance : impact sur la gestion d'actifs et la gestion actif-passif »

Les crises successives qui ont secoué les marchés financiers ces dernières années ainsi que les évolutions réglementaires, forcent les investisseurs à remettre en question leur gestion d'actifs. Le marché avance à pas forcés vers des environnements dans lesquels la gestion des risques prend une place de plus en plus prépondérante. Des vieilles techniques d'assurance de portefeuille reviennent ainsi au devant de la scène.

Dans l'optique de développement d'outils d'aide à la décision basés sur la gestion des risques, **Adina Grigoriu** et son équipe de recherche ont généralisé les modèles TPPI (Time Variant Proportion Portfolio Insurance), avec des applications dans le domaine de la gestion d'actifs et de la gestion actif-passif. Cette généralisation permet d'inclure plusieurs classes d'actifs, d'utiliser différents types de protection en fonction de l'objectif recherché et d'incorporer une variété de contraintes, y compris réglementaires.
L'utilisation de ces approches avancées permet par exemple aux fonds de pension de diminuer de 30 à 50% les contributions nécessaires pour passer d'une situation de déséquilibre actif/passif à une situation d'équilibre et de s'y maintenir.
Une partie de ces travaux se fait dans le cadre d'une thèse ayant reçu le soutien financier de l'ANRT.

• **Inscription en ligne**	• **Programme**
• **Bulletin d'inscription**	

PARTICIPATION : 60 euros

Contact : Anaele COJAN-BAUDANT au +33(0) 1 49 27 13 78 ou contact@eifr.eu.