



INNOVATIONS ET MODÈLES DE VALORISATION : THÉORIE ET PRATIQUE DANS LA GESTION D'ACTIFS

Samedi 8 octobre 2011
De 9h à 17h
Kenzi Menara Palace, Marrakech

PROGRAMME

- Présentation générale de la gestion d'actifs
 - Présentation de l'organisation du métier
 - Présentation des différentes techniques de gestion
- Utilisation des instruments dérivés dans la gestion structurée: identification, analyse et problématiques de la modélisation
 - Risques et couvertures par les dérivés
 - Modélisation des prix à terme
 - Montages et utilisations dans la gestion d'actifs
- Utilisation des modèles quantitatifs : valorisation vs mesure de risque ?
 - Modèles quantitatifs, quelles utilisations ?
 - Focus sur les modèles de valorisation
 - Application concrète sur quelques exemples de fonds à formule
- Les méthodes de valorisation dans le Private Equity
 - Présentation des méthodes de valorisation utilisées dans le Private equity
 - Introduction à l'activité
 - Les différentes modalités de valorisation
 - Les recommandations pratiques de l'IPEV
- Conclusion

PRÉSENTATION DE LA FORMATION

Organisée en marge du Forum Africain de la Finance, cette formation aborde les techniques de valorisation d'instruments financiers ainsi que le recours aux modèles quantitatifs dans la gestion d'actifs, dans un contexte d'innovation permanente pour améliorer les rendements.

QUI DOIT PARTICIPER

- Directeurs généraux • Administrateurs • Gestionnaires d'actifs et de fonds d'investissement • Directeurs des risques • Directeurs administratifs et financiers • Directeurs de développement • Directeurs systèmes d'information • Responsables techniques
- Actuaire et analystes quantitatifs • Contrôleurs de gestion • Responsables gestion actif-passif/ALM • Responsables comptables
- Auditeurs et consultants

OBJECTIFS PÉDAGOGIQUES

Cette formation devra permettre aux participants de :

- Présenter l'organisation générale du métier de la gestion d'actifs.
- Comprendre les différentes techniques de gestion d'actifs.
- Aborder l'utilisation des modèles quantitatifs dans la valorisation des fonds ainsi que l'encadrement des risques.
- Présenter les enjeux et les impacts de solvabilité sur le métier de la gestion d'actifs.
- Comprendre les problématiques de modélisation des prix,
- Prendre connaissance des produits dérivés (swaps, options, stratégies etc.) utilisés dans les stratégies de couverture et de structuration des fonds à formule.
- Comprendre la structure des prix de marché.
- Evaluer la politique de gestion et de contrôle des risques de marché.

FORMATEURS



Gilles Dunand-Roux
Associé Asset Management
Mazars, France

Gilles Dunand-Roux a acquis une expérience d'audit et de conseil auprès des acteurs du secteur financier depuis une quinzaine d'années. Ses domaines d'expertise sont l'asset management et le private equity. Il travaille essentiellement pour Axa Investment Managers, HSBC Global Asset Management, La Banque Postale Asset Management et Federal Finance Gestion. Il accompagne par ailleurs des asset managers au profil plus entrepreneurial. Ses missions le conduisent à coordonner des équipes d'audit et de conseil, ainsi qu'à certifier les comptes de près de 300 fonds. Son expérience lui permet par ailleurs d'offrir une capacité de benchmark sur les meilleures pratiques de place en matière de maîtrise des risques et de structuration du contrôle interne. Gilles Dunand-Roux est diplômé de l'INTEC et Commissaire aux Comptes.



Nordine Chokar
Senior Manager de la ligne de métier Actuariat
Mazars, France

Nordine Chokar est diplômé de l'École Polytechnique et de l'ENSAE et est titulaire du titre d'actuaire de l'Institut des Actuaire. Il a rejoint Mazars Actuariat à Paris en 2003. Il a développé son expertise et sa connaissance de la finance quantitative en traitant divers sujets relatifs à la valorisation des instruments financiers, la gestion des risques et la modélisation économique. Nordine est actuellement en charge du Pôle Ingénierie Financière de Mazars Actuariat qui compte 10 analystes quantitatifs de haut niveau. Nordine Chokar dispose d'une large expertise en matière de modèle de valorisation d'instruments financiers pour les marchés de taux, crédit, inflation, action, change, matières premières et hybrides, d'audit des modèles de valorisation de garantie financière, ainsi qu'en matière d'audit des systèmes de valorisation et suivi des risques (MUREX, SUMMIT, CALYPSO, TRADIX, NUMERIX...).

Conditions d'inscription

Le tarif de formation comprend les outils de formation, les pauses café et le déjeuner. Les participants à la formation doivent assurer leur propre hébergement et transport. A la réception de votre bulletin d'inscription à la formation vous recevrez une facture libellée en Euros ou Dirhams (Maroc). Votre règlement peut être effectué par chèque, par virement ou par carte de crédit (voir formulaire joint à cette plaquette).

Votre paiement doit être reçu dans sa totalité 48hr avant le jour de la formation pour vous permettre l'accès à la salle de formation.

En cas d'annulation de votre inscription, des pénalités seront appliquées :

Annulation dans un délai de 7 jours avant la formation, 0% de remboursement, de 8-15 jours avant la formation, 50% de remboursement, de 15 jours avant la formation, 80% de remboursement.