



Abus de Marché : Impacts sur chaîne métiers et outils

INFORMATIONS PRATIQUES

FORMAT

Séminaire

DATE

07/12/2017

LIEU

Paris

PARTICIPATION

450,00 €

INSCRIPTION

www.eifr.eu

CONTACT

contact@eifr.eu

01 70 98 06 53

Les dernières réglementations MAD/MAR ont eu des effets significatifs sur la chaîne de contrôles AMF, EURONEXT, Broker / BFI, Buy side.

L'élargissement du scope à tous les instruments, marchés et plateformes a eu des impacts sur les différentes lignes métiers concernées avec des interprétations plus ou moins convergentes. Elles ont été déclinées en règles opérationnelles spécifiques et circuits de contrôles, donc avec des enjeux à la fois techniques et comportementaux (déontologie). Des outils plus puissants (cloud/IA) permettent d'affiner les « patterns » d'abus et d'analyses lors d'investigations.

L'AMAFI a résumé les points d'attention saillants dans son guide sur les dispositifs de lutte contre les abus de marché.

Par ailleurs en amont d'autres abus peuvent provenir de l'information de marché et de la manipulation de cette information dont le contrôle de la source peut devenir une préoccupation.

Ce séminaire a pour objectif de faire le point sur ces différents enjeux pour chaque métier concerné.

Public Visé

- BFI Directeurs de la conformité et Directeurs des Risques
- Brokers et investisseurs
- Opérateurs de marché
- Régulateurs et juristes

OBJECTIFS

- Analyser les évolutions en matière de lutte contre les abus de marché et les impacts sur la gouvernance métiers
- Evaluer les risques spécifiques de marchés et leur surveillance
- Partager sur les process mis en œuvre et les points d'attention sur les best practice
- Obtenir le retour d'expérience et les attentes d'une grande banque



PROGRAMME

8h30 Introduction

Intervenants: Edouard-François de LENCQUESAING (EIFR)

8h45 Dispositif de lutte contre les abus de marché :

Intervenants: Pauline Laurent (AMAFI)

présentation du Guide AMAFI-FBF

- Le dispositif interne de surveillance et détection
 - Typologie des opérations suspectes et indicateurs
-

9h20 Surveillance EURONEXT, nature des anomalies rencontrées et actions prises

Intervenants: Fabrice Peresse (EURONEXT)

- Les différents niveaux de surveillance du dispositif EURONEXT
 - Evolution des outils technologiques
 - Problèmes liés à la définition des « curseurs » des indices d'abus de marché
-

10h10 Pause

10h25 Processus de contrôles internes BFI

Intervenants: Jean-Yves SANSAC (BNP Paribas)

11h15 Routage d'ordres et Securities services

Intervenants: Nadine Crépin (BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES)

- Protection du buy-side par rapport aux normes MIF 2
 - Elargissement des produits (complexes) concernés
 - Contribution à l'amélioration de la qualité des données
-

12h00 Information financière, source potentielle de risque ?

Intervenants: Alain Piétrancosta (UNIVERSITE PARIS 1 PANTHEON-SORBONNE ET MEMBRE DU LABEX ReFi)

- Droit communautaire (extensif) vs Droit US (aux responsabilités plus encadrées)
 - Transparence des émetteurs côtés : délit d'initié vs information permanente
-

12h40 Conclusion

Intervenants: Edouard-François de LENCQUESAING (EIFR)
