

CHAIRE ASSET MANAGEMENT DAUPHINE-AMUNDI

APPEL A CANDIDATURE ARTICLES DE RECHERCHE

**Date limite de dépôt des candidatures
15 juin 2011**

Contexte

La chaire Asset Management de la Fondation Dauphine a été créée en 2010 grâce au soutien d'Amundi, leader mondial de l'Asset Management. Son ambition est double : promouvoir et développer la recherche en Asset Management au sein de l'université Paris-Dauphine et développer des liens étroits entre la recherche et l'industrie de l'Asset Management en France et à l'international.

Objectifs

La chaire Asset Management de la Fondation Dauphine a trois objectifs principaux :

- (i) identifier les principaux courants de recherche dans le domaine de l'Asset Management et développer des recherches de haut niveau, tant sur le plan théorique que pratique ;
- (ii) construire des cours destinés à des étudiants de MBA ou de Master à partir de cas pédagogiques mis à jour annuellement et les enseigner par le biais d'une pédagogie novatrice ;
- (iii) se positionner comme interlocuteur valable des grands acteurs de l'Asset Management grâce à son savoir et à ses propositions.

Sujets

Le comité de pilotage de la Chaire invite à soumettre des papiers de recherche théoriques ou empiriques de haut niveau dans le domaine de la gestion d'actifs. Cet appel à candidature porte notamment sur les sujets suivants, sans toutefois exclure d'autres propositions :

Sujets sur l'évolution des marchés financiers

Sujet 1 « Quels biais comportementaux les agents présentent-ils en cas de crise sous hypothèse d'asymétrie d'information ? »

Sujet 2 « Mécanismes de contagion sur les marchés financiers »

Sujet 3 « Aspects comportementaux et mesure de risque (VaR, CvaR). Les primes de risque sont des mesures imparfaites d'équilibre des marchés financiers. »

Sujet 4 « La construction de mesure de sauts stochastiques de corrélation. »

Sujet 5 « Comment mesurer la diversification d'un portefeuille dans un monde où la notion de taux d'intérêt sans risque devient relative ? »

Sujets relatifs à la gestion d'actifs

Sujet 1 « Diversification des réserves de change, émergence de nouvelles devises internationales, etc. Quel impact sur l'allocation d'actifs ? »

Sujet 2 « Yuan vs Yen : quelle stratégie long terme pour la Chine ? »

Sujet 3 « L'impact des fonds souverains dans l'allocation d'actifs internationale. »

Sujet 4 « Les fonds de pension : quel modèle à long terme ? »

Sujet 5 « L'épargne à long terme : Comment inciter à son développement dans un univers financier plus instable ? »

Procédure d'admission

Une synthèse du projet devra être envoyée avant le **15 juin 2011**. L'ensemble des projets sera étudié par le comité de pilotage de la chaire Asset Management qui publiera la liste des candidats retenus le **12 juillet 2011**.

Pour vous inscrire, vous devez remplir le formulaire joint et nous le renvoyer accompagné d'un CV. Ces documents doivent :

- (i) être rédigés en anglais et envoyés sous format Pdf (sans dépasser 2 MB)
- (ii) être adressés par mail à Anne-Laure de Prémèsnil : anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr avec pour objet : "Projet de recherche – Chaire Asset Management"

Un prix de **10 000 €** sera remis à chaque projet et versé selon les modalités suivantes : 40% dans la semaine suivant la publication des candidats retenus ; les 60% restant après réception de la version finale.

La version finale du cours devra être envoyée avant le **1^{er} juin 2012** à : anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr dans un mail ayant pour objet : "Travail de recherche version finale – Chaire Asset Management".

Utilisation des travaux

Le chercheur présentera son travail lors du séminaire annuel de la chaire qui se déroulera à l'Université Paris-Dauphine dans le courant du mois de **juillet 2012** et auquel pourront être invités des chercheurs internationaux et des professionnels de l'Asset Management. La chaire prendra en charge ses différents frais de déplacement – transports, logement, etc.

Contact

Anne-Laure de Prémèsnil - 01 44 05 44 35 - anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr
Project Manager
Fondation Dauphine
Place du Maréchal de Lattre de Tassigny
75775 Paris Cedex 16

A propos d'Amundi

Amundi est née du rapprochement des expertises de gestion d'actifs de deux groupes bancaires puissants : Crédit Agricole et Société Générale. Par ce partenariat, les deux groupes concrétisent une vision commune de la gestion d'actifs selon un modèle répondant aux nouveaux défis de l'industrie et permettant de servir ses clients plus efficacement. <http://www.amundi.com/home>

A propos de la Fondation Dauphine

La Fondation Dauphine a été créée en 2008 grâce au soutien de six entreprises fondatrices : Bouygues, Bolloré, Crédit Foncier, Exane, GDF-Suez et Lagardère. BNP Paribas est Grand Partenaire de la Fondation Dauphine. Au service du développement et du rayonnement de l'Université Paris-Dauphine, l'objectif de la Fondation est d'ouvrir l'université à tous les talents et de former des managers libres et responsables. Elle abrite actuellement six chaires d'enseignement et de recherche dont la chaire Asset Management. www.fondation.dauphine.fr

CHAIRE ASSET MANAGEMENT DAUPHINE-AMUNDI

FORMULAIRE DE CANDIDATURE

à renvoyer avant le
15 juin 2011

1# Porteur de projet

Nom :
Prénom :
Fonction :
Université – entreprise :
Centre de recherché de rattachement :

2# Equipe associée

Membres	Domaine d'expertise
Nom : Prénom : Fonction : Université – entreprise : Centre de recherché de rattachement :	✓ ✓ ✓
Nom : Prénom : Fonction : Université – entreprise : Centre de recherché de rattachement :	✓ ✓ ✓

3 # CV de chaque membre (même format, un par page)

Membre # 1
A- FORMATION
B- EXPERIENCE ACADEMIQUE
C- EXPERIENCE PROFESSIONNELLE
D- PUBLICATIONS
E- DISTINCTIONS ET PRIX

4 # Description du projet de cours (5 pages maximum)