

DAUPHINE-AMUNDI CHAIR IN ASSET MANAGEMENT

# CALL FOR PAPERS

Deadline: June 30, 2012

## Context

The Chair in Asset Management of the Dauphine Foundation was created in 2010. It is sponsored by Amundi, one of the world market leaders in asset management. Its vocation is to be a catalyst to promote research at Paris-Dauphine University and a strong link with the asset management industry.

## Objectives

The Chair in Asset Management of the Dauphine Foundation objectives are three fold:

- (i) identifying the main streams of research that will structure the asset management industry in the future and developing first rank theoretical and empirical research on topics related to asset management;
- (ii) creating cutting-edge courses with applied cases on the latest topics in asset management for MBA and Master students; it also includes the introduction of new teaching methods;
- (iii) providing the Paris-place with recommendations to enhance its attractiveness.

## Topics

The steering committee of the Chair invites submissions of high-quality theoretical or empirical research papers (\*) and high-quality surveys (\*\*). This call for papers in asset management covers particularly topics such as:

### *Topics relative to financial markets*

**Topic # 1** "Behavioural aspects and risk measurement (VaR, CVaR)."\*

**Topic # 2** "Risk measurement and risk perception."\*

**Topic # 3** "Inflation hedging: is it necessary, how it should be done?"\*

**Topic # 4** "Securitisation: situation and outlook."\*\*

**Topic # 5** "Basel III: what are the impacts on financial institutions' business models?"\*

**Topic # 6** "Solvency II: what are the impacts on financial institutions' business models?"\*

### *Topics more specific to asset management industry*

**Topic # 7** "What is the future economic model for asset management?"\*

**Topic # 8** "Structuring principles of product lines based on risk."\*

**Topic # 9** "Presentation of risk levels to individual investors. Principles. Pedagogy."\*

**Topic # 10** "Diversification of foreign exchange reserves, emergence of new international currencies, etc. What impact will this have on asset allocation?"\*

**Topic # 11** "The impact of sovereign funds on international asset allocation."\*,\*\*

**Topic # 12** "Pension funds: what model should be used in the long term?"\*,\*\*

**Topic # 13** "Asset management in a new environment: what changed in 2008 and how can we adapt?"\*\*

**Topic # 14** "Portfolio management for the long term: how is it different?"\*

**Topic # 15** "Impact of financial transaction taxation on portfolio optimisation and management."\*

## Submission procedure

The deadline for research project submissions is **June 30, 2012**. All research projects will be reviewed by the board of the Chair in Asset Management. Authors will be notified about the acceptance of their research project in **July 2012**.

Complete the *enclosed form* + join a *resume for each application*. These documents must be:

- (i) in English and in PDF format with a maximum size of 2MB;
- (ii) submitted by e-mail to: [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto:anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr);
- (iii) marked "Research project application – Chair in Asset Management".

The Chair in Asset Management offers of prize of **10,000€** for each research project selected. 40% will be paid one week after the notification of acceptance.

The final version of the paper should be sent by **June 1<sup>st</sup>, 2013** by email to: [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto:anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr). The remaining 60% will be paid at the final paper version acceptance.

The papers will be presented in an upcoming **1-day workshop in Paris during summer 2013**. Academics and practitioners will be invited to participate in this conference.

### Contact information

Anne-Laure de Prèmesnil - 01 44 05 44 35 - [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto:anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr)  
Project Manager  
Fondation Dauphine  
Place du Maréchal de Lattre de Tassigny  
75775 Paris Cedex 16

### More about the sponsor

Amundi was formed by combining the asset management expertise of two major French banking groups: Crédit Agricole and Société Générale. This partnership reflects the two groups' shared vision of asset management responding to the new challenges facing the industry and allowing them to serve their clients more effectively. It has more than €680 billions in assets under management.

<http://www.amundi.com/home>

### More about the Dauphine Foundation

In 2008, the president of Dauphine University Laurent Batsch established the Dauphine Foundation thanks to the support of eight major French firms: Bouygues, Bolloré, Crédit Foncier, Exane, GDF-Suez, Lagardère, BNP Paribas and Groupe Caisse des Dépôts. The Foundation sponsors annual programs and activities that are designed to promote excellence and solidarity in the Dauphine community and abroad.  
[www.fondation.dauphine.fr](http://www.fondation.dauphine.fr)

DAUPHINE-AMUNDI CHAIR IN ASSET MANAGEMENT

# APPLICATION FORM

**Deadline: June 30, 2012**

**1# The person in charge of the research project**

Last name:  
First name:  
Position:  
University/company:  
Research centre:

**2# The team members included in the research project**

Team members	Expertise/skills
Last name: First name: Position: University/company: Research centre:	✓ ✓ ✓
Last name: First name: Position: University/company: Research centre:	✓ ✓ ✓

**3 # The resume of each member (same format, one per page)**

Member # 1
A - EDUCATION
B - ACADEMIC EXPERIENCE
C - INDUSTRY EXPERIENCE
D - PUBLICATIONS
E - HONORS & AWARDS

**4 # The description of the research project (max 5 pages)**

CHAIRE ASSET MANAGEMENT DAUPHINE-AMUNDI

## APPEL À CANDIDATURES PAPIERS DE RECHERCHE

Date limite de dépôt des candidatures  
**30 juin 2012**

### 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 : (i) promouvoir et développer la recherche en gestion d'actifs au sein de l'Université Paris-Dauphine et (ii) développer des liens étroits avec l'industrie de la gestion d'actifs.

### Objectifs

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

- (i) identifier les principaux courants de recherche dans le domaine de la gestion d'actifs et y 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 la gestion d'actifs 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 (\*) ou des revues de littérature de haut niveau (\*\*). Cet appel à candidature dans le domaine de la gestion d'actifs porte particulièrement sur les sujets suivants :

#### *Sujets relatifs aux marchés financiers*

**Sujet # 1** « Aspects comportementaux et mesure de risque (VaR, CVaR). »\*

**Sujet # 2** « Mesure du risque et perception du risque. »\*

**Sujet # 3** « Protection contre l'inflation : est-ce nécessaire, comment faire ? »\*

**Sujet # 4** « La titrisation : bilan et perspectives. »\*\*

**Sujet # 5** « Bale III : quels impacts sur les modèles économiques des institutions financières ? »\*

**Sujet # 6** « Solvency II : quels impacts sur les modèles économiques des institutions financières ? »\*

#### *Sujets relatifs à la gestion d'actifs*

**Sujet # 7** « Quel modèle économique demain pour les sociétés de gestion ? »\*

**Sujet # 8** « Principes de structuration des gammes de produits en fonction du risque. »\*

**Sujet # 9** « Présentation des niveaux de risques aux investisseurs individuels. Principes. Pédagogie. »\*

**Sujet # 10** « Diversification des réserves de change, émergence de nouvelles devises internationales, etc. Quel impact sur l'allocation d'actifs ? »\*

**Sujet # 11** « L'impact des fonds souverains dans l'allocation d'actifs. »\*,\*\*

**Sujet # 12** « Les fonds de pension : quel modèle à long terme ? »\*,\*\*

**Sujet # 13** « Gestion d'actifs dans un nouvel environnement : qu'est-ce qui a changé en 2008, comment s'y adapter ? »\*\*

**Sujet # 14** « Gérer des portefeuilles pour le long terme : en quoi est-ce différent ? »\*

**Sujet # 15** « Impact de la taxation des transactions financières sur l'optimisation et la gestion de portefeuille. »\*

## Procédure d'admission

Une synthèse du projet devra être envoyée avant le **30 juin 2012**. L'ensemble des projets sera étudié par le comité de pilotage de la chaire Asset Management qui publiera la liste des candidats retenus courant **juillet 2012**.

Pour vous inscrire, vous devez remplir le formulaire joint svp 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 Prèmesnil : [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto:anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr)
- (iii) avoir comme objet : « Projet de recherche – Chaire Asset Management »

Un prix de **10 000 €** sera remis à chaque projet sélectionné. 40% de ce montant sera payé dans la semaine qui suit la publication des candidats retenus.

La version finale du cours devra être envoyée avant le **1<sup>er</sup> juin 2013** à : [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto:anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr). Les 60% restant seront payés après acceptation de la version finale.

Le chercheur présentera son travail lors du **séminaire annuel de la chaire qui se déroulera à Paris durant l'été 2013** et auquel pourront être invités des chercheurs internationaux et des professionnels de la gestion d'actifs.

### Contact

Anne-Laure de Prèmesnil - 01 44 05 44 35 - [anne-laure.depremesnil@fondation-dauphine.fr](mailto: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 et le Groupe Caisse des Dépôts sont Grands Partenaires 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](http://www.fondation.dauphine.fr)

CHAIRE ASSET MANAGEMENT DAUPHINE-AMUNDI

**FORMULAIRE DE CANDIDATURE**  
à renvoyer avant le 30 juin 2012

**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)**