

9h30 - 10h : Café d'accueil

Animateur : Jean-François Boulier, Président d'honneur de l'Af2i



10h - 10h30

Gestion Multi Factorielle appliquée aux marchés du crédit - choix des facteurs et neutralisation des biais

Olivier Laplenie

Responsable de la Gestion Quantitative Obligataire, MAQS
(Multi Asset, Quantitative and Solutions),
BNP Paribas Asset Management



10h30 - 11h

Gestion factorielle et ESG dans le marché du crédit avant et pendant la crise du Covid-19

Takaya Sekine, CFA

Responsable Adjoint de la Recherche Quantitative,
Amundi AM



11h - 11h30

Innovations dans la gestion quantitative obligataire : les stratégies factorielles crédit appliquées aux marchés émergents & l'apport du big data dans la définition de facteurs

Patrick Houweling

co-Responsable Recherche Quantitative Crédit,
Robeco



11h30 - 12h

Comment les facteurs de crédit peuvent-ils être utilisés dans les portefeuilles institutionnels : l'analyse de cas concrets

Jay Raol

Head of Fixed Income within the Systematic and Factor Investing Group,
Invesco

12h - 14h : Cocktail déjeunatoire