



**INFORMATIONS
PRATIQUES**

FORMAT
Présentiel

MODE DE PARTICIPATION
Paris
**Club CONFAIR : 54, rue
Laffitte - Paris 9e**

DATE
**Mardi 27 Mars 2012 de
8h30 à 10h**

LIEU
**Club CONFAIR : 54, rue
Laffitte - Paris 9e
Paris**

PARTICIPATION
0 €

INSCRIPTION
www.aefr.eu

CONTACT
**contact@aefr.eu
01 70 98 06 53**

Matinale

Les Matinales de l'EIFR avec Frederic ABERGEL et Laurent GRILLET-AUBERT "Imperfections de marché et profitabilité du Trading Haute Fréquence : Enjeux et limites"

en partenariat avec l'Institut Louis Bachelier

Programme

Intervenants :

M. Frédéric ABERGEL, Directeur du Laboratoire de Mathématiques appliquées aux systèmes, Directeur de la Chair de Finance quantitative, Ecole Centrale Paris

M. Laurent GRILLET-AUBERT, Economiste Senior, Division Etudes, Stratégies et Risques, Direction de la Régulation des Affaires Internationales, AMF

Des études récentes mettent en évidence des imperfections de marché à l'échelle du trading haute fréquence (THF). Par "imperfections", on entend ici un caractère de prédictibilité qui, si on l'utilise, permet de générer des profits sous la forme d'un arbitrage statistique. La connaissance de cette profitabilité est un point de départ incontournable pour l'évaluation de l'enjeu économique et sociétal du THF.

Frédéric ABERGEL et Laurent GRILLET-AUBERT se proposent d'aborder l'importance réelle et la légitimité d'une telle activité.

Contact : Audrey PARODIN au 01 49 27 13 78, ou contact@eifr.eu.