

Assurance et marché des obligations en CHF

Structure et contenu

Gestion des actifs d'assurance

Ce séminaire donne aux participants un aperçu de la manière dont les actifs d'une assurance sont gérés. Nous traiterons des modèles de solvabilité ainsi que d'autres restrictions spécifiques à l'assurance. Nous expliquerons comment ces contraintes sont intégrées dans la définition de l'allocation d'actifs tactique et stratégique dans le cadre de la planification des placements dans une perspective ALM. Nous proposerons ensuite une introduction à la manière dont les différentes exigences sont intégrées dans la gestion d'une classe d'actifs. Enfin, nous donnerons un bref aperçu des nouveaux développements dans le domaine de l'investissement durable (ESG).

Changement dans IFRS 17/9

Le monde de l'assurance applique de nouvelles normes depuis 2023. Nous présenterons l'IFRS 17 qui se concentre sur la comptabilisation des contrats d'assurance, ainsi que l'IFRS 9, qui traite de la manière dont les compagnies d'assurance comptabilisent les actifs financiers, ce qui peut avoir un impact sur leur situation financière globale et leur performance.

Investissements sur le marché des obligations en CHF

Dans ce module, nous présenterons le travail quotidien d'un gestionnaire de portefeuille obligataire en CHF pour une assurance. À l'aide d'exemples concrets, nous analyserons les différents cadres et arbitrages possibles.

Discussion du panel "Comment une assurance investit-elle maintenant dans le marché des obligations en CHF ?

Dans cette partie, nous passons de la théorie à la pratique. Des gestionnaires de portefeuille de longue date spécialisés dans l'assurance partageront leurs connaissances approfondies et discuteront de la manière dont ils gèrent les particularités du marché obligataire en CHF. Il sera passionnant de voir où les différentes compagnies d'assurance mettent l'accent, où il y a des points communs et où il y a des différences dans les stratégies.

Public cible

Analystes financiers
Asset managers
Portfolio managers
Experts en droit et compliance
Experts en opérations des marchés financiers
Gestionnaires de patrimoine

Langue

Français/anglais

Date

05.06.2024

Heure

16h00 – 18h00, suivi d'un apéro

Lieu

FER, rue de Saint-Jean 98, 1201 Genève

Coût

Les membres de la SFAA participent gratuitement.
Pour toute les autres personnes le coût est de CHF 480, documentation inclus.

Inscription

En ligne sur <https://www.sfaa.ch/fr/ch-fr/agenda/enregistrement/>

Contact

info@sfaa.ch / ☎+41 44 872 35 40

Orateurs



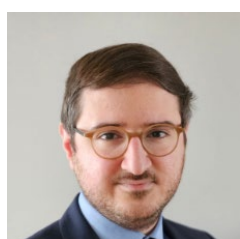
Blaise Roduit

Blaise travaille depuis 20 ans dans le domaine de la gestion d'actifs, en se concentrant sur les titres à revenu fixe. En tant que gestionnaire de portefeuille et chef d'équipe, il a une grande expérience dans la gestion de différentes stratégies obligataires telles que Absolute Return, Global Aggregate, Credit, Convertible, Emerging Markets, Short Duration High Yield, Subordinated, Insurance Portfolios. Il est titulaire d'un Master en économie de HEC Lausanne et d'un Master of Advanced Studies in Finance de l'ETHZ / Université de Zurich. Il est titulaire des certifications CIIA et CESGA. Blaise est expert et enseignant pour les formations financières de l'AZEK et membre de la commission des obligations en Suisse. Il est actuellement responsable du département Fixed Income chez Baloise Asset Management.



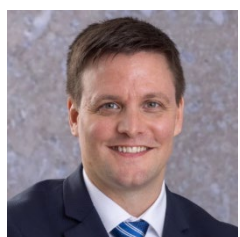
Roger Wyss

Après avoir travaillé plusieurs années dans le secteur commercial de la Banque cantonale de Zurich, Roger Wyss a rejoint le département Asset Management du Credit Suisse en 2006. En tant que gestionnaire de portefeuille pour les obligations d'entreprises et spécialiste sectoriel pour les banques, les assurances et les entreprises de services publics, il a acquis un vaste savoir-faire sur le marché des obligations en CHF. En 2023, il a fait un bref détour par Swiss Life Asset Management AG, où il a pu se faire une idée directe du monde de l'assurance. Roger Wyss est titulaire d'un bachelor en économie d'entreprise, a suivi des études postgrades en Corporate Finance et est CFA Charterholder. Il est membre de la Commission suisse des obligations.



Jack Madayan

Jack Madayan travaille depuis 2015 chez Baloise Asset Management. Après avoir débuté au back-office dans la comptabilité des fonds, il a optimisé pendant huit ans la stratégie d'investissement des placements d'assurance dans une perspective ALM en tant que stratégeste d'investissement. Actuellement, il est responsable de la stratégie de placement et de la gestion des fonds d'assurance. Il est titulaire d'un Master of Arts in Banking & Finance et d'un diplôme de Financial Risk Manager.



Cédric Willi

Cédric Willi travaille à la Baloise Asset Management depuis 2021. En tant que Senior Portfolio Manager Fixed Income, il est responsable des mandats d'assurance de la Baloise Holding ainsi que des fonds de clients. Auparavant, Cédric Willi a travaillé pour EUROFIMA, la Banque J. Safra Sarasin, la ZHAW et la Banque cantonale de Zurich. Il est titulaire d'un Master of Science in Banking & Finance et d'un diplôme de Certified International Investment Analyst (CIIA/AZEK). Cédric enseigne à la Fernfachhochschule dans le domaine Responsible Finance & Investment Strategies.



Philippe Oster

Dr. Philippe Oster a rejoint Baloise Asset Management en 2020. En tant que Senior Portfolio Manager Fixed Income, il est responsable des mandats d'assurance de la Baloise Holding ainsi que des fonds de clients. Auparavant, Philippe Oster a été Head of Portfolio Management chez Capra Ibex et Zugerberg Finanz AG. Philippe est titulaire d'un PhD in Finance de la Chair of Empirical Finance and Econometrics de la Zeppelin Université. Philippe enseigne à la Haute école de Lucerne. Il a publié de nombreux articles sur les thèmes des revenus fixes (hybrides & CoCos).