

Contrôles de suitability et suivi des portefeuilles : comment préparer l'audit LSFin

- > Quels contrôles doivent-êtré effectués par la 1^{ère} et la 2^{ème} ligne de défense ?
- > Contrôle des risques liés à la gestion de portefeuille : que va regarder l'auditeur externe ?
- > La loi et la pratique des auditeurs en matière de concentration/diversification et de contrôle des déviations

Carine Casteu,

Chief Risk Officer,
Piguet Galland & Cie SA, Genève

Taulant Avdija,

Associé, Responsable Regulatory &
Compliance Suisse romande,
BDO SA, Genève

Cecilia Peregrina,

Senior Manager,
PWC Legal, Genève

Séverine Richard,

Senior Manager, Regulatory &
Compliance Financial Services,
KPMG, Genève

Reconnaissance par



Swiss Association for Quality

Reconnaissance en tant que mesure
de recertification SAQ pour la cer-
tification "Conseiller à la clientèle
Banque"
Code SAQ: CWMA-ACFI-23-2005

Formation accréditée par



Pour cette formation accréditée par l'ASG,
les participants inscrits au programme de
formation ASG reçoivent 3 crédits.

14.00 Les contrôles par la 1^{ère} et la 2^{ème} ligne de défense en matière de suitability et de suivi des portefeuilles

- Suivi du profil investisseur du client dans le temps
- Adéquation de la stratégie d'investissement choisie par le client avec son profil d'investisseur
- Contrôles relatifs au caractère approprié des transactions y compris documentation dans le CRM
- Contrôles relatifs à l'adéquation des transactions y compris documentation dans le CRM
- Suivi global des portefeuilles (adéquation, concentration, éligibilité des produits...)
- Définition des indicateurs de risque et des objectifs non financiers des RMs

Carine Casteu

14.40 Les premières observations de l'audit LSFin en matière de contrôle de la suitability

- Le contrôle des risques liés à la gestion de portefeuille et les exigences de conformité en matière de risques de marchés : que va regarder l'auditeur externe ?
- Contrôles manuels et automatisés des processus liés à LSFin

Taulant Avdija

15.30 Pause-café

15.50 Quelles sont les exigences du régulateur et les précisions apportées par les tribunaux en matière de concentration / diversification ?

- Concentration : les rappels récents de la FINMA : incertitudes sur le risque de concentration et sur l'utilisation des propres produits de placement ; la notion de concentration selon la jurisprudence
- La notion de diversification : quelles précisions dans la jurisprudence ? Quels axes de diversification préconiser (types d'actifs, diversification géographique, par devise, par secteur, value/growth, notion de décorrélation entre classes d'actifs) ?

Cecilia Peregrina

16.20 Le contrôle et la documentation des déviations par rapport à la stratégie d'investissement

- Les déviations et leur remontée : qu'est-ce qu'une déviation, causes (déviation due aux conditions de marché, déviation à la demande du client) ?
- Exemples de déviations, problème de l'importance de la déviation, sa durée...
- Différence du problème des déviations en période normale et en période de crise / de krach
- Contrôles de la documentation des déviations : vérifier que les documentations des violations des règles (breach) sont satisfaisantes : exemples de bonne qualité de la documentation de la violation ou de mauvaise qualité

Séverine Richard

17.00 Fin de la conférence

GENÈVE, MERCREDI 15 NOVEMBRE 2023, 14.00-17.00, HÔTEL PRÉSIDENT / ONLINE (ZOOM)

INFORMATION & INSCRIPTION

Tel: +41 22 849 01 11
Fax: +41 22 849 01 10
info@academyfinance.ch
Academy & Finance SA
PO Box 1344, CH-1227 Carouge
www.academyfinance.ch

PRIX

560 CHF (+ TVA 7.7%)
Gestionnaires de fortune membres de
l'ASG : 460 CHF; autres gestionnaires
de fortune : 490 CHF
Inscriptions supplémentaires de la
même société : -50%

☐ Je m'inscris au séminaire "Contrôles de suitability et suivi des portefeuilles" le 15 novembre

Je participerai : ☐ dans la salle ☐ online sur Zoom Gestionnaire de fortune : ☐ ASG : ☐

Nom et prénom

Fonction

Société.....

Adresse

Code postal et ville

TelEmail.....

Date Signature