

Livre IV - Produits d'épargne collective

Titre I - Organismes de placement collectif en valeurs mobilières

Chapitre unique - Organismes de placement collectif en valeurs mobilières

Section 4 - Calcul du risque global

Paragraphe 1 - Mesure du risque global des OPCVM sur les contrats financiers

Sous-paragraphe 3 - Méthode du calcul de la valeur en risque

Règlement général de l'AMF

Article 411-79 en vigueur au 21 octobre 2011

AVERTISSEMENT : Les indications contenues dans les encarts sont fournies au lecteur à titre d'information. Il n'est donné aucune garantie quant au caractère exhaustif des dispositions législatives et réglementaires applicables et l'Autorité des marchés financiers ne saurait être tenue pour responsable d'un quelconque préjudice qui serait lié directement ou indirectement à la mise à disposition et à l'utilisation de ces informations.

Article 411-79

La société de gestion met en place :

- 1 • Un dispositif de contrôle *a posteriori* des calculs issus du modèle sur des données passées, afin de surveiller la précision et la performance du modèle de valeur en risque ;
- 2 • Un dispositif de tests de résistance rigoureux, complet et adapté au profil de risque de l'OPCVM permettant de simuler le comportement de l'OPCVM dans des situations de crise.
- 3 • Lorsque le profil de risque et la stratégie d'investissement le demandent, des outils et méthodes de gestion des risques adaptés au profil de risque et à la stratégie d'investissement de l'OPCVM en complément des dispositifs mentionnés aux 1° et 2°.

↘ Version en vigueur au 21 octobre 2011

